clearstream | DEUTSCHE BÖRSE GROUP

CASCADE Handbuch Band 1

für Kunden der Clearstream Banking

(Einführung, Abwicklung Börsen- und OTC-Geschäft, Geldregulierung)

April 2015

CASCADE Handbuch Band 1

Clearstream Banking AG, Frankfurt

Dokument-Nummer: F-CON04

April 2015

Die im vorliegenden Dokument enthaltenen Informationen können ohne weitere Mitteilung geändert werden und stellen keine Zusage seitens Clearstream Banking AG, Frankfurt (nachfolgend als Clearstream Banking Frankfurt oder CBF bezeichnet) oder eines anderen zu Clearstream International, société anonyme gehörenden Unternehmens dar. Ohne die ausdrückliche schriftliche Zustimmung von Clearstream Banking Frankfurt

darf kein Teil des vorliegenden Handbuches zu irgendeinem Zweck in irgendeiner Form oder auf irgendeine Weise, einschließlich der Erstellung von Fotokopien und Aufzeichnungen, reproduziert oder übertragen werden.

Vorbehaltlich gegenteiliger Angabe erfolgen alle Zeitangaben in Mitteleuropäischer Zeit (MEZ).

© Copyright Clearstream Banking AG, Frankfurt (2015). Alle Rechte vorbehalten.

Vorwort

Dieses Benutzerhandbuch informiert den Kunden von Clearstream Banking Frankfurt (nachfolgend CBF) über die Bedienung der Online-Anwendung CASCADE-Host der CASCADE-Abwicklungsplattform. Neben der Beschreibung der Online-Funktionalitäten liefert das Benutzerhandbuch auch Hintergrundinformationen zur Wertpapierabwicklung über CASCADE.

Das Benutzerhandbuch untersteht den Allgemeinen Geschäftsbedingungen von CBF. Die im CASCADE-Benutzerhandbuch enthaltenen Informationen gelten in Verbindung mit anderen CBF-Publikationen (CBF Customer Handbook, CBF Connectivity Handbook, CASCADE Link Guides), Kundeninformationen und sonstigen Benutzerhandbüchern, die weitere Details hinsichtlich der Nutzung der Serviceleistungen von CBF beschreiben. Gültig ist jeweils die aktuelle Fassung auf der Internetseite www.clearstream.com.

Für Fragen zu Inhalten dieses Handbuchs wenden Sie sich bitte an Ihren Client Services Officer oder Relationship Manager.

Das CASCADE-Benutzerhandbuch ist in drei Bände aufgeteilt mit folgender Inhaltsstruktur:

Band 1

- Allgemeine Informationen zur CASCADE-Plattform und Systeminformationen zur Online-Schnittstelle
- Abwicklung von Börsengeschäft (ohne CCP - Central Counterparty Einbindung
- Abwicklung von OTC-Geschäft
- Abwicklung von CCP OTC Transaktionen (Surplus Deliveries)
- Geldregulierung Euro und Fremdwährung aus der CASCADE/LION Abwicklung

Band 2

- GS Bestandsführung und Depotumsätze
- Custody Services (Income und Non Income)
- Special Services zu Namensaktien
- Special Services zu Global Securities Financing
- Reporting (Listen und Auswertungen)
- Tabellen und Schlüsselverzeichnisse
- Glossar

Band 3

- Abwicklung für Ein- und Auslieferung
- Allgemeine Informationsdienste (z. B. Umsatzinformationen)
- Reporting (Listen und Auswertungen)
- Depotdisposition und Depotbuchung für Ein- und Auslieferungen
- Euro-Umstellung für Wertpapiere
- Glossar
- Tabellen und Schlüsselverzeichnis

Inhalt

1 Einführung ... 7

1.1 CASCADE-Plattform der CBF ... 7
1.2 Erfassungs- und Auftragsstatus ... 8

2 OTC-Geschäfte ... 9

2.2 Settlementzyklen ... 10
2.2.1 Geldverrechnung ... 11
2.2.2 Wichtige Zeitpunkte im CASCADE Tagesablauf ... 13
2.2.3 Wichtige Zeitpunkte im CASCADE Buchungstag ... 17
2.2.4 Dispositionsprioritäten ... 18
2.2.5 Feiertagsregelung ... 23
2.3 Technische Grundlagen ... 24
2.3.1 Anmeldung zu den Online-Serviceleistungen ... 24
2.3.2 Tastenbelegung ... 26
2.3.3 Online Passwortänderung ... 27
2.3.4 Anmelden am Online-System ... 28
2.3.5 Abmelden vom Online-System ... 35
2.3.6 Allgemeingültige Feldeingaberegeln ... 36
2.3.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen ... 37
2.3.8 Spezifische Feldbeschreibungen und Formalprüfungen ... 55
2.4 Kontakte ... 58
2.4.1 Ansprechpartner für CASCADE ... 58

3 Abwicklung Börsengeschäft (ohne CCP) ... 59

3.1 Auftragserteilung ... 60
3.2 Auftragsbearbeitung – Settlement (LS) ... 61
3.2.2 Settlement-Sperre und –Freigabe (SB) ... 63
3.2.3 Gesamt-Rückstellung (GR) ... 66
3.2.4 Rücknahme Gesamt-Rückstellung (RG) ... 68
3.3 Auftragsbearbeitung – Änderung und Löschung (LA) ... 69
3.3.2 Änderung von Lieferpositionen (AL) ... 72
3.3.3 Rücknahme Lösch-Kennzeichen (RL) ... 77
3.4 Informationen (LI) ... 78
3.4.2 Lieferposition (IB) ... 82
3.4.3 Aufgaben (IA) ... 85
3.4.4 Kontroll- und Abstimmsummen (IK/IS) ... 86

4 Abwicklung OTC-Geschäft ... 90

4.1 Auftragserteilung (EE) ... 92

4.1.1 Einzelerfassung von Wertpapier-Überträgen mit/ohne Gegenwert (Kontrahent im Inland) (WE) ... 92
4.1.2 Einzelerfassung von Wertpapier-Überträgen mit/ohne Gegenwert (Kontrahent im Ausland) (WE) ... 102
4.1.3 Mehrfacherfassung von Wertpapier-Überträgen mit/ohne Gegenwert (Kontrahent im Inland) (WM) ... 111
4.1.4 Erfassung von Match-Instruktionen (MI) ... 114
4.1.5 Erfassung TEFRA D Freigabe (TD) ... 125
4.1.6 Einzelerfassung von BWV-Überträgen (BE) ... 131
4.1.7 Erfassung von LSV-Überträgen (LE) ... 135
4.1.8 Erfassung Umtausch GBC (UT) ... 140
4.1.9 Erfassung Rücktausch GBC (RT) ... 143
4.1.10 Erfassung Optionsscheintrennung (OT) ... 146
4.1.11 Erfassung Optionsscheinzusammenführung (OZ) ... 150
4.1.12 Erfassung Strip-Aufteilung (SA) ... 153
4.1.13 Erfassung Strip-Zusammenführung (SZ) ... 155
4.2 Auftragsbearbeitung im Erfassungsstatus (EA) ... 157
4.2.1 Änderung von Aufträgen ... 157
4.2.2 Löschung von Aufträgen (EA) ... 160
4.2.3 Information Erfassungsstatus (EI) ... 162
4.3 Kontrolle (EK) ... 166
4.3.1 Kontrolle über die Vollanzeige (EK) ... 167
4.3.2 Kontrolle über die tabellarische Kurzanzeige (EK) ... 171
4.3.3 Kombination Einzelkontrolle/Blockkontrolle ... 173
4.4 Auftragsbearbeitung im Auftragsstatus (AA) ... 174
4.4.1 Markierung zur Änderung (MA) ... 174
4.4.2 Markierung zur Löschung (ML) ... 177
4.4.3 Information zum Auftragsstatus (AI) ... 179
4.5 Matching ... 193
4.5.1 Erweiterte Kriterien zum Matching ... 194
4.5.2 Verarbeitung Matching ... 194
4.5.3 Direct Matching ... 195
4.5.4 Zusätzliche Kriterien für Matching ... 195
4.5.5 Übersicht zum Match-Dienst (AM) ... 197
4.5.6 Bearbeiten offener Match-Aufträge/Match-Instruktionen (MA / MI) ... 199
4.5.7 Fehlerhafte Match-Aufträge/Match-Instruktionen (MA/MI) ... 201
4.5.8 Rücknahme des Match-Status bei einem bestätigten Auftrag (RM) ... 204
4.5.9 Information zu bestätigten Match-Aufträgen/Match-Instruktionen (MA/MI) ... 206
4.5.10 Löschung von Cross-Border Geschäften ... 207
4.6 Settlement ... 208
4.6.1 Sperre bzw. Freigabe von Aufträgen für die Disposition (SA, SI, FA , FI) ... 209

4.6.2 Informationen ... 214
4.7 Reservierungs-Dienst im Real-Time-Settlement (AR) ... 218
4.7.2 Anzeige Reservierungen mit Gegenwert EUR (IR) ... 220
4.7.3 Anzeige Reservierungen mit Gegenwert Fremdwährung (IW) ... 221
4.7.4 Rücknahme der Reservierung (RR) ... 222

5 Abwicklung von CCP-Instruktionen ... 223
5.1 Auftragserteilung ... 223
5.2 Auftragsbearbeitung und Settlement in EUR ... 223
5.2.1 Besonderheiten für CBF Equity CCP Konto (8501) ... 223
5.2.2 Regulierung von Geschäften in Wertpapieren gegen Zahlung in EUR ... 224
5.2.3 Regulierung von Geschäften in Wertpapieren gegen Zahlung in Fremdwährung ... 224
5.3 Auftragsbearbeitung und Settlement in CHF ... 224
5.3.1 Regulierung von Geschäften in schweizer Wertpapieren gegen Zahlung in CHF via Schweizerische Zentralbank ... 224
5.4 Reporting regulierter CCP-Instruktionen ... 225
5.4.1 Regulierungsliste Euro ... 225
5.4.2 Regulierungsliste für Fremdwährung (FW) ... 225
5.4.3 Buchungstextschlüssel ... 225
5.4.4 Regulierungsdatenträger MT536 ... 225
5.4.5 SWIFT-Settlement Confirmations (MT544-MT547) und Weiterleitungen (MT578) ... 226

6 Geldregulierung in Euro ... 227
6.1 Nachtverarbeitung (STD, RT-STD) Tagesverarbeitung (Cont-SDS1, SDS1, Cont-SDS2, SDS2) ... 228
6.1.1 Auftragserteilung (EE) ... 229
6.1.2 Auftragsbearbeitung (EA) ... 241
6.1.3 Information Geldaufträge (GI) ... 246
6.2 Information Kapitaldienste und sonstige Geldumsätze ... 279
6.3 Geldverrechnung für CASCADE-RTS-Geschäfte in Euro (GK) ... 291

7 Geldregulierung in Fremdwährung (GC) ... 298
7.1 Information von CASCADE-FWG-Geschäften ... 298
7.1.2 Anzeige Verarbeitungs-Status ... 300
7.1.3 Tabellarische Kurzanzeige der FWG-Aufträge ... 301
7.1.4 Vollanzeige ... 303

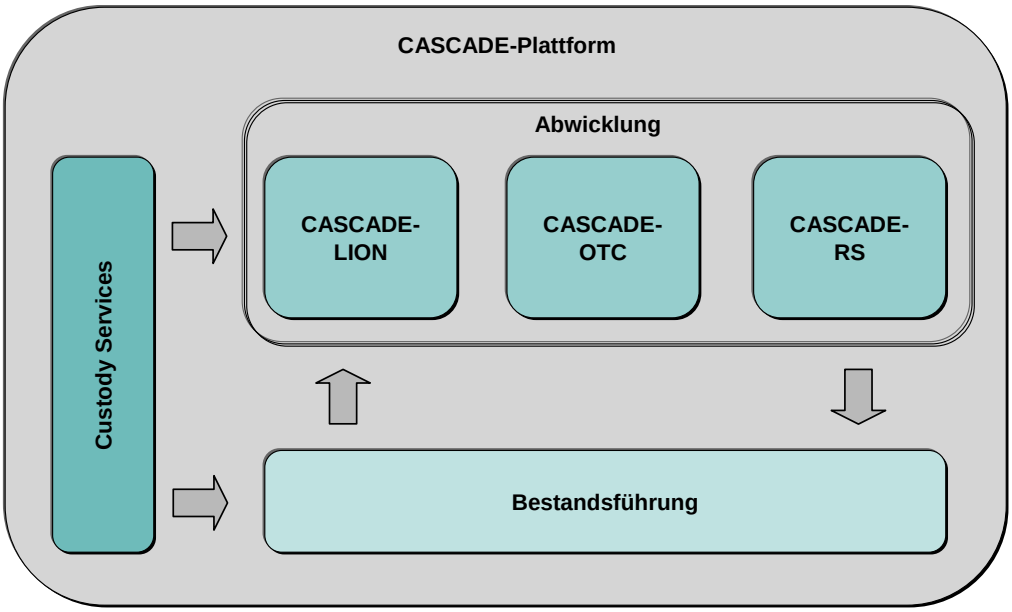
1 Einführung

1.1 CASCADE-Plattform der CBF

Dieses Kapitel dient zur Erläuterung grundlegender Begriffe, die zum Verständnis des vorliegenden Handbuchs erforderlich sind. Für zusätzliche Informationen zu den CBF-Services wird auf das CBF Kundenhandbuch verwiesen.

CBF stellt mit dem System CASCADE eine hocheffiziente Plattform für die Abwicklung von Transaktionen in deutschen und internationalen Wertpapieren zur Verfügung. CASCADE steht für Central Application for Settlement, Clearing and Depository Expansion und umfasst die Auftragserteilung und Bearbeitung der Wertpapierübertragungs- und Wertpapierverwaltungsaufträge der CBF-Kunden, das Zusammenführen von gegenläufigen Lieferinstruktionen mit und ohne Gegenwertverrechnung (Matching), die technische Verrechnung der zusammengeführten Geschäfte zur Optimierung der Wertpapierübertragungsprozesse (Settlement) und die Erfüllung der Geschäfte mittels Regulierung der Wertpapier- und Geldseite in Euro (in Kooperation mit der Deutschen Bundesbank) oder in Fremdwährung über die entsprechenden Geldkonten der Clearstream Banking (commercial bank money). Zudem werden in CASCADE die bei CBF girosammelverwahrten, zur Belieferung von Transaktionen verwendbaren Wertpapierbestände der Kunden abgebildet. Für Namensaktien, die über das CASCADE RS-System verwaltet werden, ist eine erweiterte Bestandsführung bis zur Aktionärsebene möglich. Auch werden spezifische Dienste z. B. Umschreibung von Aktienbeständen unter Einbeziehung des Aktienbuches des jeweiligen Emittenten exklusiv angeboten.

Auf die Wertpapierbestände bietet CBF verschiedene Services an, wie z. B. die Abrechnung und Zahlung sowie das Inkasso von Erträgniszahlungen (Zins- und Dividendenzahlungen), Rückzahlungen und Provisionen oder die Abwicklung von Kapitalmaßnahmen.



Services der CBF auf Basis der CASCADE-Plattform

Über CASCADE werden Instruktionen aus den folgenden Bereichen abgewickelt:

- CASCADE-LION unterstützt die Anzeige und Bearbeitung offener Lieferpositionen aus dem Börsengeschäft. In LION (Lieferfreigabe Online) werden Lieferpositionen aus Geschäften eingestellt, die über Xetra, Parketthandel oder PÜEV (Platz-Überschreitender Effektenverkehr) gehandelt und nicht gegen den Zentralen Kontrahenten (CCP = Central Counterparty) abgewickelt werden. Nachfolgend wird mit dem Begriff „Börsengeschäft" alle an CBF erteilten Lieferaufträge bezeichnet, die in CASCADE-LION als Lieferposition eingestellt werden.
- CASCADE-OTC unterstützt die Abwicklung von außerbörslichen (OTC = over the counter) Wertpapiertransaktionen. Hierzu zählen auch die von Eurex Clearing AG (CCP) an CBF übermittelten Lieferinstruktionen. Nachfolgend wird mit dem Begriff „OTC-Geschäft" alle an CBF erteilten Wertpapieraufträge bezeichnet, die nicht als Börsengeschäfte in CASCADE-LION eingestellt werden.
- CASCADE-RS bietet zusätzliche Services, die für die Administration von Namensaktien (RS = Registered Shares) erforderlich sind, wie z. B. Zulassung, die Ersteintragung und Umschreibung von Aktionären im Aktienregister und erweiterter Bestandsführung.

1.2 Erfassungs- und Auftragsstatus

1.2.1.1 Börsengeschäfte (ohne CCP)

Die zur Abwicklung des Börsengeschäfts erforderlichen Aufträge werden automatisch aus den jeweiligen Handelssystemen als offene Lieferpositionen in CASCADE-LION eingestellt. Im Gegensatz zum OTC-Geschäft weisen Börsengeschäfte keinen Erfassungsstatus auf. Die Einstellung in CASCADE-LION erfolgt immer im Auftragsstatus. Des Weiteren werden in CASCADE die Lieferinstruktionen aus Börsengeschäften keinem Matching, d. h. dem Abgleich von Käufer- und Verkäuferseite, unterzogen.

2 OTC-Geschäfte

Die Abwicklung von OTC-Aufträgen erfolgt durch entsprechende Auftragserteilung der an einer Wertpapiertransaktion beteiligten Parteien. Ein Auftrag kann online erfasst oder via CASCADE LIMA File Transfer, SWIFT Netzwerk oder IBM WebSphere MQSeries in CASCADE eingestellt werden.

Ein online erfasster Auftrag wird zunächst mit Erfassungsstatus in den Erfassungsbestand von CASCADE eingestellt und nach der Kontrolle und Freigabe durch den Auftraggeber gemäß Vier-Augen-Prinzip mit Auftragsstatus in den Auftragsbestand übergeleitet. Ein per LIMA File Transfer, SWIFT Netzwerk oder IBM WebSphere MQSeries übermittelter Auftrag wird nach formaler und inhaltlicher Prüfung durch CBF direkt in den CASCADE-Auftragsbestand (Auftragsstatus) eingestellt.

Sobald ein OTC-Auftrag gegen oder frei von Zahlung den Auftragsstatus erreicht hat versucht CASCADE, diesen mit einem gegenläufigen Auftrag der Gegenpartei zusammenzuführen (Matching).

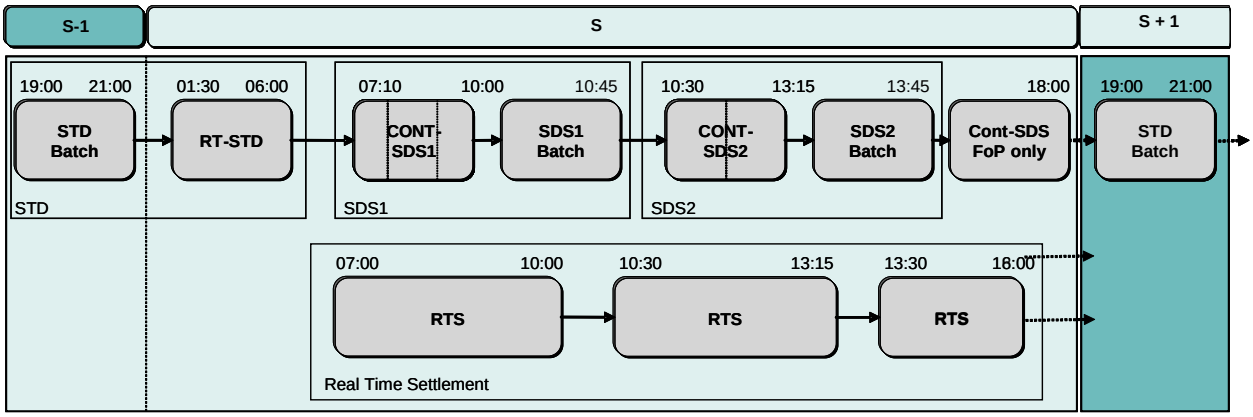
2.1.1.1 CCP-Instruktionen

Die vom CCP an CBF übermittelten Aufträge sind Lieferspitzen (surplus deliveries) aus dem Netting Prozess und/oder Bruttolieferungen werden als OTC-Geschäft mit Auftragsstatus in CASCADE eingestellt. Im Falle von Aufträgen mit und ohne Zahlung übermittelt der CCP zusätzlich zu dem eigenen Auftrag einen entsprechenden Gegenauftrag im Auftrag des Kontrahenten (POA) an die entsprechende Settlement Lokation.

2.2 Settlementzyklen

Eingehende Lieferaufträge in CASCADE werden in unterschiedlichen Dispositions- bzw. Settlementzyklen verarbeitet. CASCADE bietet zur Regulierung von Wertpapieren und Geld eine Nachtverarbeitung (STD) und mehrere Tagesverarbeitungen (Cont-SDS1, SDS1, Cont-SDS2 und SDS2) an. In jedem dieser Verarbeitungsläufe werden Lieferaufträge entweder per Massenverarbeitung (Batch) oder durch ein Continuous Settlement (Cont) reguliert. Zusätzlich haben Kunden der CBF noch die Möglichkeit am Real-Time-Settlement (RTS) teilzunehmen, bei dem Wertpapiere ohne und gegen Zahlung reguliert werden.

Die nachfolgende Abbildung stellt den zeitlichen Ablauf der von CASCADE unterstützten Settlementzyklen dar (S = vorgesehener Settlementtag bzw. Erfüllungstag). Für CBF beginnt der Erfüllungstag am Vorabend mit Start der Nachtverarbeitung (STD) und endet mit der letztmöglichen Tagesverarbeitung am Erfüllungstag (RTS). Die einzelnen Settlementzyklen werden im CBF Customer Handbook beschrieben.



CASCADE – Übersicht der Settlementzyklen

2.2.1 Geldverrechnung

Die Regulierung von Zahlungen aus Wertpapiertransaktionen, Kapitaldiensten, Gebühren und Spesen erfolgt außerhalb der CASCADE-Plattform. CBF bedient sich für die Geldregulierung Zentral- bzw. Korrespondenzbanken (cash agents), bei denen die Kunden der CBF entsprechende Geldkonten führen.

2.2.1.1 Euro Zahlungen via Deutsche Bundesbank

Über die Deutsche Bundesbank werden alle Zahlungen in EUR verrechnet, die sich aus der Regulierung von Wertpapiertransaktionen und Kapitaldiensten von girosammelverwahrten Wertpapieren sowie aus der Abrechnung von Gebühren und Spesen ergeben.

Zahlungen aus Wertpapiertransaktionen:

Die Zahlungen werden nach Beendigung der jeweiligen Abwicklungsläufe über die TARGET2 Plattform des Betreibers Eurosystems verrechnet:

- Die Zahlungen aus der Nachtverarbeitung (STD und RT-STD) werden am Morgen des Erfüllungstages ab 06:00 Uhr als Saldo verrechnet.
- Die Tagesverarbeitung besteht aus dem Continuous Settlement mit insgesamt fünf Zeitfenstern bzw. Zyklen sowie den beiden Batchverarbeitungen SDS1 und SDS2. Zahlungen werden am Ende des jeweiligen Laufs als Saldo verrechnet:

Cont SDS1	C1F1	07:00
	C1F2	08:00
	C1F3	09:00
SDS1		Ca. 10:40
Cont-SDS2	C2F1	12:00
	C2F2	13:15
SDS2		Ca. 13:45

- Die Geldverrechnung für RTS-Transaktionen erfolgt auf Bruttobasis, das heißt einzeln pro Transaktion. Die Zahlung erfolgt vom RTGS-Konto des Käufers auf das RTGS-Konto des Verkäufers. Die Abwicklung von OTC mit Gegenwert Euro (DvP/RvP)-Transaktionen innerhalb der RTS-Verarbeitung ist bis 16:00 Uhr möglich, für OTC mit Gegenwert Fremdwährung (DvP/RvP)-Transaktionen ist bis 17:30 Uhr möglich. Euro GC-Pooling-Transaktionen können bis 17:40 Uhr abgewickelt werden. Die Frist für Abwicklungen ohne Gegenwert (D-FoP/R-FoP)-Transaktionen ist um 18:00 Uhr.

Zahlungen aus Kapitaldiensten:

- Ausschüttungen in EUR durch deutsche Zahlstellen werden am Zahlbarkeitstag getrennt von der Wertpapierabwicklung in zwei Läufen (DD1 und DD2) über TARGET2 reguliert. Bei deutschen Wertpapieren fällt der Zahlbarkeitstag in der Regel mit dem Ex-Tag des Events zusammen.

DD1	09:30 Uhr
DD2	13:45 Uhr
DD3	15:15 Uhr (nur für manuell generierte Zahlungen)

- Ausschüttungen in EUR durch ausländische Zahlstellen werden am Zahlbarkeitstag in DD2 über TARGET2 reguliert. Bei ausländischen Wertpapieren kann der Zahlbarkeitstag vom Ex-Tag des Events abweichen.
- Eine Ausnahme bilden die Zins- und Rückzahlungen von Bundesanleihen. Die Geldverrechnung erfolgt hier bereits in der Standardverarbeitung (STD) am Vorabend des Zahlbarkeitstages.
- Zahlungen in Verbindung mit freiwilligen Corporate Action Events (z.B. Ausübung von Optionsrechten) werden manuell von CBF generiert und können sowohl in DD1, DD2 oder in DD3 verrechnet werden

Gebühren und Spesen:

- Die Abrechnung von Gebühren und Spesen erfolgt monatlich in EUR über die RTGS-Konten der Kunden. Die Kunden der CBF müssen hierzu als direkter TARGET2-Teilnehmer (Direct Participant) über ein RTGS-Konto verfügen oder sich einer Korrespondenzbank bedienen, die als Direct Participant an TARGET2 angeschlossen ist.

2.2.1.2 Zahlungen in Fremdwährungen via Commercial Bank Money (Creation-Plattform)

Über die Creation-Plattform erfolgt die Geldverrechnung in Fremdwährung, resultierend aus GS Wertpapiertransaktionen (OTC und LION) und Zahlungen aus Kapitaldiensten zu Wertpapieren in Girosammelverwahrung. Des Weiteren werden über Creation auch Euro-Zahlungen reguliert, die sich aus Wertpapiertransaktionen in Wertpapierrechnung verwahrten Gattungen (ausschließlich LION Börsengeschäfte) ergeben.

2.2.1.3 CHF Zahlungen via Schweizer Nationalbank

Dieser Link wird ausschließlich zur Geldverrechnung von Wertpapiertransaktionen in GS-verwahrten schweizer Wertpapieren gegen CHF verwendet. Zahlungen in CHF, die nicht aus Wertpapiertransaktionen in girosammelverwahrten schweizer Gattungen resultieren, werden als Fremdwährungszahlung über die Creation-Plattform verrechnet. Voraussetzung ist allerdings, dass beide Kontrahenten eine entsprechende direkte oder indirekte Kontoverbindung unterhalten.

Für weitere Informationen zur Geldregulierung wird auf das CBF Kundenhandbuch verwiesen.

2.2.2 Wichtige Zeitpunkte im CASCADE Tagesablauf

Zur Einhaltung bestimmter Fristen ist es notwendig, einen Überblick für die täglich stattfindenden Prozesse zu erhalten. Die nachfolgend aufgeführten wichtigen Zeitpunkte sind im Tagesablauf zu beachten. Die angegebenen Fristen sind nur dann gültig, wenn die vom Kunden gelieferten Instruktionen für eine vollautomatisierte Verarbeitung (Straight Through Processing) geeignet sind. Im lokalen Markt muss der Kunde zusätzlich für ausreichende Deckung sorgen. Wenn eines dieser Kriterien nicht erfüllt ist, kann CBF keine fristgemäße Abwicklung garantieren.

Wichtiger Hinweis: Im Rahmen der internen Compliance-Verfahren der CBF werden alle eingehenden Kundeninstruktionen automatisch vor Eintritt in die Transaktionsverarbeitung gescannt. Werden Instruktionen intern derart gekennzeichnet, dass sie eine weitere manuelle Untersuchung benötigen, werden diese in den Status Offen gesetzt. Dieser Status wird den Kunden sofort über ihre gewählten Kommunikationskanal(e) berichtet, bis die Instruktionen entweder manuell zur Verarbeitung freigegeben oder abgelehnt werden. Zur Gewährleistung einer Untersuchung der Instruktionen sowie der Einhaltung der geltenden Fristen, wird den Kunden empfohlen, Instruktionen spätestens 15 Minuten vor der jeweiligen Frist einzugeben.

Uhrzeit	Aktivität
01:30	Starten des CASCADE Systems Online und der RT-STD Disposition
01:30 bis 06:00	Online-Eingabe für RT-STD -Aufträge Euro/Fremdwährung
01:30	Fortlaufend aktualisierte Online-Geldanzeige Euro „Cash Forecast“ zur Unterstützung der Euro Gelddisposition. Fortlaufend aktualisierte Online-Geldanzeige Fremdwährung „Commercial Bank Money“ für aktuell offene und bestätigte OTC- und Börsengeschäfte gegen Fremdwährung
Ab 01:30 bis 16:00	Online-Eingabe für RTS Aufträge mit Gegenwert Euro
Ab 01:30 bis 17:30	Online-Eingabe für Aufträge mit Gegenwert Fremdwährung
Ab 01:30 bis 18:00	Online-Eingabe für Aufträge ohne Gegenwert
Ab 01:30 bis 22:00	Settlement-Confirmation SWIFT real-time
02:00	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
03:00	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
05:00	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
05:45	Annahmeschluss der DFÜ/SWIFT-Aufträge für die RT-STD für taggleiche Verarbeitung
06:00	C+S Statement DFÜ
06:00	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
Bis 06:30	Rückmeldung von CBF an TARGET2 über tatsächlich verrechneten Geldbetrag (Soll oder Haben) aus der Geldverrechnung für die STD-Verarbeitung Online-Eingabe, Disposition und Reservierung für Cont–SDS1 Aufträge (Öffnung TARGET2)

Uhrzeit	Aktivität
07:10 bis 08:00 (C1F1)	Erster Zyklus der Cont-SDS1: C1F1 Die Cont-SDS1-Verarbeitung besteht aus 3 Zeitfenstern (Zyklen), zu deren Beginn jeweils Liquidität analog der Nachtverarbeitung (STD) durch den Kunden bereitzustellen ist. Der reservierte Betrag an Zentralbankliquidität wird für die Dauer des folgenden Zeitfensters auf dem der CBF dedizierten RTGS Unterkonto blockiert. Für die Abwicklung herangezogen werden Wertpapieraufträge, die ordnungsgemäß erteilt, gematcht und zur Abwicklung freigegeben (keine Settlement-Sperre) sind. Erfolgreich verarbeitete Transaktionen erreichen sofortige Finalität. Die Abwicklung von Wertpapier Aufträgen gegen Geld ist am Ende eines jeden Zyklus abgeschlossen. Ein verbleibender Geldsaldo wird auf das RTGS-Unterkonto oder das RTGS-Hauptkonto des Kunden (je nach Wunsch) ausgeschüttet. Bei einer Ausschüttung auf das RTGS-Unterkonto steht der Betrag für den nächsten Settlementzyklus zur Verfügung. Nach Ende eines Zeitfensters erfolgt die Geldreservierung für das nächste Zeitfenster zu den festgelegten Reservierungsfristen innerhalb der Cont-SDS1-Verarbeitung. Euro Reservierungsauftrag zur Geldreservierung für die C1F1 Verarbeitung wird aufgrund des vom Kunden an CBF erteilten Dauerauftrags automatisch erstellt (sofern kein manuell erteilter Reservierungsauftrag vorliegt)
07:30	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
08:00	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
08:00	C+S Statement DFÜ
08:00	Reservierungsdeadline für C1F2
08:00 bis 09:00 (C1F2)	Zweiter Zyklus des Cont-SDS1: C1F2 (über RTGS-Unterkonto) und Reservierung für den dritten Zyklus (siehe C1F1 für eine detailliertere Beschreibung)
09:00	Reservierungsdeadline für C1F3
09:00	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
09:00	C+S Statement DFÜ
09:00 bis 10:00 (C1F3)	Dritter Zyklus des Cont-SDS1: C1F3 (über RTGS-Unterkonto siehe C1F1 für eine detailliertere Beschreibung)
09:30	DD1
09:45	Annahmeschluss der DFÜ/SWIFT-Aufträge für die SDS1/Batchverarbeitung für taggleiche Verarbeitung
10:00	Annahmeschluss Online-Aufträge für SDS1/Batchverarbeitung für taggleiche Verarbeitung
10:00	C+S Statement DFÜ
10:00 bis ca. 10:20	Start SDS1-Abwicklung von OTC- und Börsengeschäften (Wertpapiere und Geld). Alle erfolgreich verarbeiteten Transaktionen erreichen sofortige Finalität.
10:45	Versand an CSDs DFÜ/SWIFT
Ab 10:30 bis 11:00	C+S Statement DFÜ

Uhrzeit	Aktivität
10:30	CASCADE-RS – Zuweisung für Umschreibung/Ersteintragung/Aktionärsdatenänderung
10:45	Reservierungsdeadline für C2F1
10:45 bis 12:00 (C2F1)	Erster Zyklus des Cont-SDS2: C2F1 (siehe C1F1 für eine detailliertere Beschreibung)
11:15	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
12:00	Reservierungsdeadline für C2F1
12:00 bis 13:15 (C2F2)	Zweiter Zyklus des Cont-SDS2: C2F2 (siehe C1F1 für eine detailliertere Beschreibung)
12:00	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
12:00	C+S Statement DFÜ
12:45	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
13:00	Annahmeschluss der DFÜ/SWIFT-Aufträge für SDS2
13:15	Annahmeschluss für Online-Aufträge für SDS2 sowie Reservierungsfrist für Same-Day-Settlement 2 (SDS2)
13:15 bis ca. 13:30	Start SDS2-Abwicklung von OTC- und Börsengeschäften (Wertpapiere und Geld. Alle erfolgreich verarbeiteten Transaktionen erreichen sofortige Finalität).
13:15	C+S Statement DFÜ
13:30	CASCADE-RS – Zuweisung für Umschreibung/ Ersteintragung/ Aktionärsdatenänderung
13:45	DD2
13:45	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer) abhängig von Cont-SDS2
13:45	Bereitstellen der Geldtagesauszüge für die CASCADE Konten
13:30 bis 14:00	C+S Statement DFÜ
14:00	Versand an CSDs DFÜ/SWIFT
15:15	DD3
15:30	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
15:45	Annahmeschluss für RTS-Aufträge per DFÜ/SWIFT (mit Gegenwert Euro)
16:00	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
16:00	CASCADE-RS – Zuweisung für Umschreibung/Ersteintragung/Aktionärsdatenänderung
16:00	Annahmeschluss für RTS-Aufträge per Online mit Gegenwert Euro
16:00	C+S Statement DFÜ
17:00	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
17:15	Annahmeschluss für RTS-Aufträge per DFÜ/SWIFT mit Gegenwert Fremdwährung für taggleiche Verarbeitung
17:30	Annahmeschluss für RTS-Aufträge per Online mit Gegenwert Fremdwährung für taggleiche Verarbeitung

OTC-Geschäfte

Uhrzeit	Aktivität
17:00	C+S Statement DFÜ
17.40	Annahmeschluss für RTS Treasury spezifische Transaktionen per Online (Euro GC-Pooling)
17:45	Annahmeschluss für Aufträge per DFÜ/SWIFT ohne Gegenwert für taggleiche Verarbeitung
18:00	Annahmeschluss für Online Aufträge ohne Gegenwert Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer) nach Ende - Buchungsschnitt
18:00	Bereitstellen der Geldtagesauszüge und Kontoinformation für die CASCADE Konten
18:00	CASCADE-RS – Weiterleitung an Aktienregister Umschreibung/Ersteintragung/Aktionärsdatenänderung
18:00	Spätester Zeitpunkt für die Disposition von Euro Liquidität (Geld und Sicherheiten) für die STD-Verarbeitung Valuta nächster Bankarbeitstag auf dem Bundesbankkonto
18:00	C+S Statement DFÜ
19:00	Deadline für die manuelle Eingabe eines Reservierungsauftrags in CASCADE zur Geldreservierung für die STD-Verarbeitung.
18:45	Annahmeschluss für DFÜ/SWIFT-Aufträge und -Börsengeschäfte (STD-Verarbeitung Valuta nächster Tag) für taggleiche Verarbeitung
19:00	CASCADE online Ende
19:00	Euro Reservierungsauftrag zur Geldreservierung für die STD-Verarbeitung wird aufgrund des vom Kunden an CBF erteilten Dauerauftrags automatisch erstellt (sofern kein manuell erteilter Reservierungsauftrag vorliegt)
19:15 bis 02:00	Keine Verarbeitung der eingehenden DFÜ/SWIFT-Aufträge (Queue Aufbau)
19:30	Versand an CSDs DFÜ/SWIFT
19:30	Start STD-Abwicklung von OTC- und Börsengeschäften (Wertpapiere und Geld) „Valuta nächster Bankarbeitstag“ und Verarbeitung von Zahlungen aus Kapitaldiensten des Bundes; Verrechnung der Ergebnisse aus der Abwicklung und Zahlungen aus Kapitaldiensten des Bundes zum „tatsächlich verbrauchten Geldbetrag“ (Soll) bzw. Gutschrift (Haben). Alle erfolgreich verarbeiteten Transaktionen erreichen sofortige Finalität. Stückereservierung für freigegebene LION Fremdwährungsbörsengeschäfte und CASCADE OTC Fremdwährungstransaktionen
19:30	Weitergabe des Reservierungsauftrags durch CBF an das TARGET2-System
ab 19:30	Rückmeldung der bestätigten (bzw. blockierten) Geldliquidität auf dem CBF zugewiesenen RTGS-Unterkonto.
19:45	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
21:00	C+S Statement (100) DFÜ nur GS-Geschäfte
22:00	Query Lauf (Infodienst CASCADE File Transfer)
22:00	Statement of Holdings DFÜ
21:00 bis 01:00	Keine Verarbeitung der ausgehenden Nachrichten bei SWIFT (Queue Aufbau)
23:00	C+S Statement (nur AKV-Börsengeschäfte), DFÜ
01:00	KADI-Ergebnisse SWIFT
01:00	Settlement-Confirmation SWIFT (aus STD-Verarbeitung)

2.2.3 Wichtige Zeitpunkte im CASCADE Buchungstag

Folgende Dispositionen und Buchungen laufen mit der gleichen Buchungsvaluta (Depot und TARGET2-Geldverrechnung):

Buchungstag (Valuta) Uhrzeit	Aktivität
19:00	Batch Disposition und Buchung für STD/SDS-Aufträge, RTS-Aufträge mit Gegenwert und Börsengeschäfte (Valuta heute per morgen)
01:30 bis 06:00	Disposition für RT-STD –Aufträge
	Am Wochenende und an Feiertagen, an denen CASCADE geschlossen ist, endet die Verarbeitung am Samstagmorgen um 05:30 Uhr. Die Nachtverarbeitung mit Valuta Montag beginnt mit der STD am Freitagabend und endet mit der RT-STD um 05:30 Uhr am Montagmorgen. Der wesentliche Unterschied zwischen der Verarbeitung an den Arbeitstagen der Woche und der Verarbeitung am Wochenende besteht in den Queries, die für Valuta Montag bereits am Samstag um 02:00 Uhr und 03:00 Uhr versendet werden. Analog gilt dies auch für Feiertage, an denen CASCADE geschlossen ist.
06:00 bis 10:00	Disposition für Cont-SDS1 Aufträge
07:00 bis 16:00	RTS mit Gegenwert EURO
19:00 bis 18:00	SDS ohne Gegenwert
10:00 bis 10:20	Buchung der Wertpapiere für 1. SDS-Aufträge und Börsengeschäfte mit gleichtätiger Valuta
11:00 bis 13:15	Disposition für Cont-SDS2 Aufträge.
13:15 bis 13:30	Buchung der Wertpapiere für 2. SDS-Aufträge und Börsengeschäfte mit Gegenwert Euro mit gleichtätiger Valuta. Für den aktuellen Verarbeitungstag ist eine Stückereservierung für freigegebene Börsengeschäfte in Fremdwährung nicht mehr möglich
bis 16:00	Disposition und Buchung für RTS-Geschäfte mit Gegenwert EUR
bis 17:30	Disposition und Buchung für OTC-Transaktionen mit Gegenwert Fremdwährung
07:00 bis 17:40	RTS Treasury spezifische Transaktionen (Euro GC Pooling)
bis 18:00	Disposition und Buchung der SDS Geschäfte ohne Gegenwert

2.2.4 Dispositionsprioritäten

In jeder Batchverarbeitung bestimmen die Prioritäten die Reihenfolge, in der die Aufträge verarbeitet werden sollen. Der Wertebereich der Prioritäten liegt zwischen 1 und 4. In den Batchverarbeitungen sind verschiedene möglich, wobei jeder Auftrag mit der Standardpriorität 4 vorbelegt wird. Werden Aufträge an das Continuous Settlement (Cont–SDS) übergeben, so spielt die Vergabe von Prioritäten keine Rolle.

2.2.4.1 Standardreihenfolge der Verarbeitung von Auftragsarten

Folgende Verarbeitungsalgorithmen gelten für die einzelnen Auftragsarten:

2.2.4.1.1 Verarbeitungsschritt 1 (CASCADE-RS-Disposition)

In jeder Batchverarbeitung besteht eine standardisierte Reihenfolge, in der die Aufträge verarbeitet werden. Die Auftragsarten sind zu diesem Zwecke in CASCADE grundsätzlich in sogenannte Prioritätsgruppen unterteilt. Diese Einteilung legt die generelle Reihenfolge der Auftragsarten fest. Innerhalb der Auftragsarten werden die Geschäfte nach Nominale absteigend und nach Settlement-Day aufsteigend geordnet, bevor sie verarbeitet werden.

Prioritätsgruppe	Auftragsart
0	Systembuchung
1	Einlieferung Neuzulassung Valutierung
2	Bestandsübertrag
3	Depotübertrag intern Depotübertrag extern
4	WPÜ TR → VR WPÜ VR → TR
5	WPÜ EE mit Gegenwert WPÜ EE ohne Gegenwert
6	Auslieferung

2.2.4.1.2 Verarbeitungsschritt 3 (Hauptdisposition GS)

In jeder Batchverarbeitung besteht eine standardisierte Reihenfolge, in der die Aufträge verarbeitet werden. Die Auftragsarten sind zu diesem Zwecke in CASCADE grundsätzlich in sogenannte Prioritätsgruppen unterteilt. Diese Einteilung legt die generelle Reihenfolge der Auftragsarten fest. Innerhalb der Auftragsarten werden die Geschäfte nach Nominale absteigend und nach Settlement-Day aufsteigend geordnet, bevor sie verarbeitet werden.

Die Reihenfolge der Auftragsarten ist nach den Auswirkungen auf die Dispositionsergebnisse und dem Risikoaspekt erstellt worden. So sind zum Beispiel Einlieferungen und WP-Leihe-Rückführungen in der zweithöchsten Prioritätsgruppe angesiedelt. (Einlieferungen erhöhen den Bestand, ohne den eines Kontrahenten zu verringern und Wertpapierleihe-Rückführungen sind wegen des Charakters der Leihe mit einer hohen Priorität zu versehen.) Nachfolgend werden die Prioritätsgruppen beschrieben. Hierbei ist zu beachten, dass abgelehnte Geschäfte mit Continuous Settlement in der nächsten Batchverarbeitung mit der eingegebenen Priorität verarbeitet werden.

Prioritätsgruppe	Auftragsart
1	Storno Depotumsätze*) Kapitalveränderungen (Non Income)*) Nachbuchungen Depotumsätze*)
2	Einlieferungen GS-Geschäfte aus dem Börsenlieferbestand EGCP-Aufträge Verpfändungen: WP-Leihe-Sicherheiten EUREX-Sicherheiten WP-Leihaufträge Rücknahmeauftrag
3	Freigaben von Verpfändungen WP-Überträge mit Gegenwert WP-Leihe-Rückführungen Verpfändungen: unter Banken*) Treuhandkonto
4	Auslieferungen Umtausch Rücktausch Optionsscheintrennung Optionsscheinzusammenführung
5	WP-Übertrag ohne Gegenwert BWV - bzw. LSV-Überträge

*) Diese Auftragsarten sind nur der CBF vorbehalten.

Die Reihenfolge innerhalb der Prioritätsgruppen beschreibt die interne, standardisierte Verarbeitungsabfolge der Geschäfte.

2.2.4.2 Verarbeitungsschritte 2 und 4 (Vorab- und Nachdisposition)

In der Vorab- und Nachdisposition erfolgt die Verarbeitung der Aufträge unabhängig von der eingegebenen Priorität. Die Reihenfolge der Verarbeitung wird durch die vorliegende Verknüpfung (z. B. Umtausch) bestimmt.

Vorab- und Nachdisposition:

1. KADI-Non Income-Auftrag ohne Verknüpfung
2. GBC Umtausch
3. WP-Übertrag Teilrechte in Vollrechte /Vollrechte in Teilrechte, Originalaktien in Anteil Spitzen/Anteil Spitzen in Originalaktien
4. Strip-Aufteilung
5. Strip-Zusammenführung
6. Optionsscheintrennung
7. Optionsscheinzusammenführung
8. Xemac – Aneignung mit Bestandübertrag
9. WP-Übertrag Bonds
10. Auslieferung Umlegung von GS/Vorratslager und umgekehrt

2.2.4.3 Einflussmöglichkeiten durch den Anwender

Der Auftraggeber kann für die Stückedisposition für einen Auftrag generell zwischen vier verschiedenen Prioritäten auswählen.

Die Prioritätenvergabe kann die Reihenfolge der Verarbeitung beeinflussen.

Es besteht die Möglichkeit, die Reihenfolge innerhalb einer Auftragsart oder innerhalb einer Prioritätsgruppe zu verändern. Es ist jedoch auch möglich, den Auftrag in die höchste Prioritätengruppe (Gruppe 2) einzustufen.

In der nächsten Tabelle werden die verschiedenen Prioritäten aufgezeigt:

Eingabewert	Beschreibung
1	Batchverarbeitung - Dieser Wert bewirkt, dass der Auftrag in die höchste Prioritätsgruppe gehoben wird (prioritätsgruppenüberschreitend) (=→ Prioritätsgruppe 2).
2	Batchverarbeitung - Dieser Wert bewirkt, dass der Auftrag innerhalb seiner Prioritätsgruppe an die erste Stelle gerückt wird (innerhalb einer Gruppe).
3	Batchverarbeitung - Dieser Wert bewirkt, dass der Auftrag innerhalb seiner Auftragsart an die erste Stelle gerückt wird (innerhalb einer Auftragsart).
4	Batchverarbeitung - Standardwert eines Auftrages.

2.2.4.4 Auswirkungen der Prioritätensetzung

Mit der Prioritätensetzung wird dem Auftraggeber ein Instrument zur Verfügung gestellt, welches weitreichende Folgen für die Geschäftsabwicklung und für die Ergebnisse der Dispositionsverarbeitung haben kann. Durch die Veränderung der Priorität kann der Kontoinhaber bewirken, dass für ihn wichtige Geschäfte in der Disposition entsprechend vorrangig verarbeitet werden.

Jedoch könnten durch die Vergabe hoher Prioritäten eventuell Geschäfte mit einer hohen Sicherheitsanforderung (wie z. B. WP-Leihe-Rückführungen) in der Disposition abgelehnt werden. Das wäre der Fall, wenn ein normaler Wertpapierübertrag mit der Priorität 2 versehen und eine Rückführung dann mangels Bestand abgelehnt würde.

In der folgenden Tabelle wird anhand von Vergleichswerten die ursprüngliche Priorität jedes Auftrages erläutert (Standardpriorität 4). Weiterhin ist der Tabelle zu entnehmen, welche Auswirkung eine Änderung der Priorität zur Folge hat.

2.2.4.4.1 CASCADE Auftragsabwicklung – Disposition

Auftragsart	Prioritätenschlüssel			
	Standard-Priorität (4)	Mittlere Priorität (3)	Hohe Priorität (2)	Höchste Priorität (1)
Storno Depotumsatz	105	102	101	100
KADI Non Income Depotumsatz	115	-	-	-
Nachbuchung Depotumsatz	125	121	101	100
Einlieferung	205	202	201	200
Umtausch GBC	205	202	201	200
Strip-Aufteilung	205	-	-	-
Strip-Zusammenführung	205	-	-	-
Lieferbestand: GS-Geschäfte	 215	 211	 201	 200
Rücknahmeauftrag	215	211	201	200
Verpfändung: WPL-Sicherheiten Eurex-Sicherheiten	 225 235	 221 231	 201 201	 200 200
WPL-Leihauftrag	235	231	201	200
Freigabe von Verpfändungen	305	301	300	200
WPL-Rückführung	315	311	300	200
WP-Übertrag mit Gegenwert	315	311	300	200
Verpfändung: Pfand unter Banken Treuhandkonto	 325 325	 321 321	 300 300	 200 200
Auslieferung	405	401	400	200
Rücktausch GBC	405	401	400	200
Optionsscheintrennung	405	-	-	-
Optionsscheinzusammenführung	405	-	-	-
WP-Übertrag ohne Gegenwert	505	501	500	200
BWV /LSV-Übertrag	505	501	500	300
Selbstbesicherung Eröffnungstransaktionen Rückführungstransaktionenen	 600 600	 600 600	 600 600	 600 600

2.2.4.4.2 CASCADE-Auftragsabwicklung in Namensaktien (RS) - Disposition:

Auftragsart	Prioritätenschlüssel			
	Standard-Priorität (4)	Mittlere Priorität (3)	Hohe Priorität (2)	Höchste Priorität (1)
Systembuchung	-	-	-	051
Einlieferung	154	153	152	151
Neuzulassung	154	153	152	151
Aufstockung	154	153	152	151
Bestandsübertrag	254	253	252	251
Depotübertrag intern Depotübertrag extern	354 354	353 353	352 352	351 351
WPÜ TR-→VR	454	453	452	451
WPÜ VR-→TR	454	453	452	451
WPÜ EE mit Gegenwert	554	553	552	551
WPÜ EE ohne Gegenwert	564	563	562	561
Auslieferung	654	653	652	651

2.2.4.5 Erweiterter Verarbeitungsalgorithmus in der STD-Verarbeitung

In der Standard-Batchverarbeitung (STD) unterstützt der in den beiden vorangegangenen Kapiteln Standardreihenfolge der Verarbeitung von Auftragsarten und

Auswirkungen der Prioritätensetzung und beschriebene Verarbeitungsalgorithmus neben der Wertpapierdisposition auch die Geldseite. Dabei ist die Wertpapierseite (Verkäufe) führend. Gegenüber den anderen Batchverarbeitungen SDS1 und SDS2 wird die ebenfalls in den beiden vorangegangenen Kapiteln Standardreihenfolge der Verarbeitung von Auftragsarten und

Auswirkungen der Prioritätensetzung beschriebene Ermittlung der Rangfolge der Transaktionen für das Settlement um ein zusätzliches Kriterium erweitert.

Demnach ermittelt sich die Rangfolge der Instruktionen eines Kunden innerhalb einer Wertpapiergattung nach folgenden Kriterien:

1. numerische, instruktionstypabhängige Dispositionspriorität aufsteigend (standardmäßig mit Default-Werten vorgegeben), die vom Kunden in den Verkäufen über eine Einstufung (1 - 4) beeinflusst werden kann)
2. „ältester" Settlementtag aufsteigend
3. Nominale absteigend
4. ZUSÄTZLICH NUR IN DER STD-VERARBEITUNG: Gegenwert absteigend.

Darüber hinaus werden zur Deckungsprüfung der Geldseite alle Instruktionen gattungsübergreifend (d. h. ohne Bevorzugung bestimmter Gattungen) zusätzlich in eine Gesamtreihenfolge gebracht (nach den Kriterien 1, 2 und 4, Gattung und Nominale spielen dann nur noch eine untergeordnete Rolle). Bei aus Sicht der Geldprüfung völlig gleichen Positionen (inklusive identischem Gegenwert) entscheidet ein Zufallsprinzip über die Reihenfolge. Für Kunden, die gemäß der Nettovariante ihr CBF-Geldverrechnungskonto sowie das damit verbundene Bundesbankkonto anderen Kunden zur Verfügung stellen, gibt es dadurch keine Bevorzugung von Instruktionen bestimmter CBF-Konten.

In der eigentlichen Verarbeitung durchlaufen die Instruktionen den Prüfungsprozess „erst Stücke, dann Geld". Im Falle von fehlendem Wertpapierbestand oder fehlendem Geld wird diese Verarbeitung in Wiederholungsschleifen so lange durchgeführt, bis die vorhandenen Wertpapier- oder Geldmittel aufgebraucht sind.

Im Falle fehlender Liquidität für die STD-Verarbeitung wird der Dispositionsstatus „abgelehnt, Geld nicht ausreichend" zu Informationszwecken genutzt. Dies gilt sowohl für die CASCADE-Bildschirmmasken (KVAI) als auch die CASCADE-Tagesliste „nicht zur Buchung Valuta *TT.MM.JJJJ* übernommen".

2.2.5 Feiertagsregelung

2.2.5.1 Allgemein

Die CBF veröffentlicht regelmäßig zum Ende eines Jahres eine Kundeninformation (www.clearstream.com), in der den Kunden die Feiertagsregelung für das folgende Jahr mitgeteilt wird.

2.2.5.2 Regelungen für Crossborder-Geschäfte

Für die Regulierung von Crossborder-Wertpapierüberträgen ist die Feiertagssituation der beiden direkten CSDs entscheidend. Nationale Feiertage im Ausland werden entsprechend berücksichtigt. Hat einer der beiden direkten Kontrahenten am Settlement-Tag einen Feiertag, so findet kein Settlement statt.

2.2.5.3 Feiertage mit TARGET Service

Die Öffnungszeiten von CASCADE lehnen sich an denen des europäischen Zahlungssystems an. Damit steht CASCADE den Kunden auch an den nationalen Feiertagen 24. Dezember und 31.Dezember eines jeden Jahres zur Verfügung. Ein Börsenhandel findet jedoch an diesen Tagen zurzeit nicht statt.

2.3 Technische Grundlagen

2.3.1 Anmeldung zu den Online-Serviceleistungen

Die Einrichtung einer Dialogverbindung erfordert folgende Maßnahmen:

Der Kunde der Clearstream Banking AG, Frankfurt (CBF) fordert einen Systemfragebogen von der Kundenbetreuung der CBF an. Dieser ist ausgefüllt an die vorgegebene Adresse zurückzusenden.

Wenn noch keine Postleitung existiert, stellt die Deutsche Börse Systems AG (Systems) bei der TELEKOM einen Postleitungsantrag, der auch dem Kunden der CBF zur Unterschrift zugeht (Dauer bis zur Schaltung der Leitung: zurzeit 6-8 Wochen).

Nachdem die Postleitung geschaltet worden ist, erfolgt von der Deutsche Börse Systems AG die Generierung der Leitung in der System-Software (Generierungsrhythmus: ca. vier Wochen).

Vom Kunden sind die gewünschten Anwendungen bei der Clearstream Banking AG, Frankfurt zu beantragen, d. h. aufgrund der Dialogverbindung besteht (nach Bedarf) die Möglichkeit einer universellen Nutzung aller Inland-Anwendungen der CBF (CASCADE, LION, WSS).

Die Betriebssicherheit IT der Gruppe Deutsche Börse wird davon in Kenntnis gesetzt und der Hauptsecurity-Beauftragte sendet dem Kunden der CBF den Antrag „Berechtigung zur Nutzung von Anwendungen der Gruppe Deutsche Börse“.

2.3.1.1 Das Zugriffsschutz-System

Mit Einführung der Datenbanksoftware „IMS“ ist gleichzeitig ein Security-System installiert, das einen weitestgehend Schutz der IMS-Online-Anwendungen vor Missbrauch ermöglicht.

Voraussetzung für das Security-System ist eine Security-Datenbank (Benutzer-Datenbank), in der jeder Benutzer mit seinem eindeutigen Identifizierungs-Kennzeichen (ID-KZ) und Passwort sowie seinen Transaktionsberechtigungen gespeichert ist. Diese Transaktionsberechtigungen werden von dem Kunden-Security-Beauftragten den verschiedenen Mitarbeitern zugeordnet.

In jeder Bank müssen zwei Security-Beauftragte benannt sein, die sich in ihren Aufgabenbereichen folgendermaßen unterscheiden:

- Der Bank Security-Beauftragte zur PflegeAufgaben: Pflegen der Berechtigungsdaten in der Security-Datenbank, d. h. Funktionscodeberechtigungen können erfasst, geändert, gelöscht sowie angezeigt werden.
- Der Bank Security-Beauftragte zur Freigabe
  Aufgaben: Kontrolle und Freigabe der Anwendungsberechtigungen, die der Kunden-Security-Beauftragte zur Pflege vergeben hat.

Im Folgenden wird der Aufbau des Mitarbeiter-Security-Daten-Formulars erläutert, das Sie von Ihrem „Security-Beauftragten“ erhalten haben. Hier wird Ihnen mitgeteilt, für welche Transaktionen und Funktionen von CASCADE oder Custody (oder von anderen IMS-Anwendungen der Gruppe Deutsche Börse) Ihnen eine *Zugriffsberechtigung* zugewiesen worden ist.

Im oberen Teil des Formulars wird neben dem User-Identifizierungskennzeichen, dem Namen und Vornamen der zugriffsberechtigten Person auch das Ersterfassungs-Passwort angegeben. Dieses Passwort wird beim Ersteinstieg in das System vom User im Online-Passwortänderungsdienst in ein eigenes Passwort umgeändert. Außerdem wird der Status „Ersterfassung", „Änderung" oder „Löschung" aufgeführt.

Im unteren Teil des Formulars können drei Transaktionscodes zugeteilt werden. Für weitere Transaktionscodes müssen zusätzliche Blätter ausgefüllt werden. Insgesamt stehen pro Transaktionscode 100 Stellen zur Verfügung:

- Stelle 1-4: 4-stelliger Transaktionscode
- Stelle 9-10: hier kann angegeben werden, ob der Mitarbeiter für einen Funktionscode zugelassen ist ("=" --> positiv Steuerung) oder nicht ("/=" bzw. "=/" --> negativ Steuerung)
- Stelle 11-100: Angabe von zweistelligen Funktionscodes zu einem Transaktionscode, die durch eine Leerstelle voneinander getrennt sein müssen

Beispiele

Für den Transaktionscode „KVEK" existieren folgende Funktionscodes: „VA", „VN", „VP", „VL", „VG", „TA", „TN", „TP", „TL", „TG".

Der Anwender soll beim Transaktionscode „KVEK" die Zugriffsberechtigung für die Funktionscodes „VA", „VN", „VP", „VL", „VG" erhalten:

```
          1                   2
1 2 3 4   9 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9

K V E K   =   V A   V N   V P   V L   V G
```

Der Anwender erhält beim Transaktionscode „KVEK" die Zugriffsberechtigung für alle Funktionscodes außer „VA" und „VP".

```
          1                   2
1 2 3 4   9 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9

K V E K   / = V A   V P
```

Der Anwender erhält beim Transaktionscode „KVEK" die Zugriffsberechtigung für alle Funktionscodes.

```
          1                   2
1 2 3 4   9 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9

K V E K
```

2.3.2 Tastenbelegung

Taste	Erklärung
Enter bzw. Datenfreigabe	*Auswahlmenümasken:* Prüfung der Eingaben; Sind die Eingaben korrekt, wird in die nächste Ebene verzweigt. *Erfassungsmaske:* Prüfung der Eingaben. *Tabellarische Anzeigemasken:* Prüfung der Eingaben. Wird KZ = „I" eingegeben, so führt ENTER zur Informationsvollanzeige des gekennzeichneten Auftrages.
Tabulatortaste	Vor- / Rückwärtsspringen auf das nächste eingabefähige Feld.
PF1	Führt in verschiedenen Transaktionen zur Anzeige einer Hilfemaske.
PF2	Führt zu einem Online Druck aus der Informationsvollanzeige heraus. Weiterhin kann im Rahmen der tabellarischen Kurzanzeige der Transaktion KVAI ein Online Druck mit PF2 sowie durch Kennzeichnung mit "D" vorgenommen werden. Zusätzlich kann aus der tabellarischen Anzeige der Transaktion "KVAV" ein Online-Druck aktiviert werden. (Voraussetzung für den Ausdruck ist eine leitungsbezogene Bildschirmzuordnung zum Drucker.)
PF3	Führt zu einer Verarbeitung der eingegebenen Daten (=Eingabebestätigung).
PF4	Mit PF4 wird ein Dialog *ohne* Verarbeitung abgebrochen. Anschließend wird das jeweilige Auswahlmenü angezeigt.
PF5	Nur bei tabellarischen Anzeigen: Wenn aufgrund einer Zeitüberschreitung die Datenbanksuche abgebrochen werden musste, initiiert PF5 ein Weitersuchen nach Aufträgen in der Datenbank.
PF6	Führt zu einer Verarbeitung der eingegebenen Daten und blättert gleichzeitig innerhalb eines Vorganges bei bestimmten CASCADE-Auftragsarten vor.
PF7	Falls Folgemasken existieren: Ermöglicht ein Zurückblättern zur vorangegangenen Maske innerhalb eines Vorganges.
PF8	Falls Folgemasken existieren: Ermöglicht ein Vorwärtsblättern zur Folgemaske innerhalb eines Vorganges.
PF9	Nicht belegt.
PF10	Nicht belegt.
PF11	Wie bei PF4 erfolgt ein Abbruch des Dialogs *ohne* Verarbeitung. Bewirkt zusätzlich die Abmeldung vom System CASCADE und den Rücksprung in das Gruppe Deutsche Börse-Einstiegsmenü.
PF12	Nicht belegt.

2.3.3 Online Passwortänderung

Mit Hilfe dieser Funktion kann die Änderung eines Passwortes durchgeführt werden:

Transaktionscode „MENU" (1. Zeile) durch „PWAD" überschreiben.

Als Ergebnis erscheint das Passwortänderungs-Menü:

```
TRAN: PWAD FC:    SB:

----------------------  P A S S W O R T  -  AENDERUNG  ----------------------




IDENTIFIZIERUNGS-KZ        :

ALTES PASSWORT             :

NEUES PASSWORT             :

WIEDERHOLUNG NEUES PASSWORT:




PFK1: HELP FUNKTION   PFK4: VORGANGSABBRUCH
-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 07:02:28 -- ****

SY0010A BITTE GEBEN SIE IDENTIFIZIERUNGS-KZ, ALTES UND NEUES PASSWORT EIN
```

**** nur Musterdaten

Folgende Eingaben sind notwendig:

- Identifizierungskennzeichen
- Altes Passwort
- Neues Passwort
- Wiederholung des neuen Passwortes

Hinweis: Ein Passwort muss 8-stellig sein und kann aus den Zeichen „A" bis „Z" bzw. „0" bis „9" bestehen.

Werden die Daten korrekt eingegeben, wird die Passwortänderung durch eine Bildschirmmeldung bestätigt.

Generell kann eine Passwortänderung zu jedem Zeitpunkt vorgenommen werden. Darüber hinaus wird in folgenden Fällen automatisch der Passwortänderungsdienst aufgerufen:

- Zur Änderung des Ersterfassungs-Passwortes
  Das vom Bank-Security-Beauftragten erhaltene Erst-Passwort muss vor Nutzung des Systems geändert werden.
- Bei Ablauf des Passwort-Gültigkeitszeitraumes
  Der Gültigkeitszeitraum eines Passwortes beträgt drei Monate, d. h. im Abstand von drei Monaten muss das Passwort geändert werden.

Durch Drücken der PF4-Taste kann der Passwortänderungsdienst abgebrochen werden.

Informationen zur Passwortänderung können durch Betätigen der PF1-Taste abgerufen werden.

2.3.4 Anmelden am Online-System

Vorgehensweise beim Aufruf von CASCADE:

Bildschirm einschalten.

Es erscheint der Begrüßungsbildschirm der Gruppe Deutsche Börse:

```
Deutsche Boerse Systems

System P1P3

Nodename: B790743G   IP-Adresse: 172.19.36.155     Port: 22123



Call Center

-Telefon:    069-211-11000
-Telefax:    069-211-11001
```

IMS1 eingeben und Datenfreigabetaste betätigen.

Als Ergebnis wird das Einstiegsmenü der Gruppe Deutsche Börse eingeblendet:

```
TRAN: MENU FC:    SB:

                              G r u p p e  D e u t s c h e  B o e r s e


Anwendungen stehen Ihnen aus folgenden Bereichen zur Verfuegung:

AK:  Clearstream Banking AG, Frankfurt   KS:  Clearstream Banking AG, Frankfurt
     International                            Domestic

BI:  XONTRO                              TR:  TRICE Meldewesen

WS:  Wertpapier - Service - System       EK:  Engagementkontrolle

SO:  Sonstige Dienstleistungen

TRAN=DSLE: SWIFT/MERVA


Verlassen IMS: TRAN=/RCL + evtl. vorh. Daten in FC, SB, ID-KZ, PW loeschen

-- ID-KZ: 7930260002 -- PW:          ------ B793058S -- 19/11/14 -- 09:58:38 --

SY0043A BITTE DATEN EINGEBEN
```

In der ersten Zeile im Feld „FC" das Kürzel „KS" für Anwendungen der CBF Domestic eingeben.

In der vorletzten Zeile das ID-KZ (10-stelliges, numerisches, persönliches Identifizierungs-Kennzeichen) und Passwort eingeben.

Datenfreigabe (ENTER).

Es erscheint das Auswahlmenü der CBF Domestic Anwendungen:

```
TRAN: MENU FC:    SB:



           C l e a r s t r e a m   B a n k i n g ,   F r a n k f u r t


Funktionsangebot fuer Clearstream Banking, Frankfurt - Domestic

CA:  CASCADE - Auftragsabwicklung WP     CE:  CARAD - Emissionsueberwachung

CG:  CASCADE - Auftragsabwicklung GELD   CP:  CARAD - Pruefstellen

CK:  CASCADE - Dienste                   CD:  CARAD - Stueckenummernverwaltung

CR:  CASCADE - Dienste Namensaktien      KU:  Kundenstammdaten

KA:  Kapitaldienste                      EO:  Allgemeine Dienste

                                         TB:  Taxbox Abgeltungsteuer Service

-- ID-KZ: 7930260002 -- PW:          ------ B793058S -- 19/11/14 -- 10:00:18 --

SY0096A BITTE WAEHLEN SIE AUS
```

2.3.4.1 (A) CASCADE Auftragsabwicklung Wertpapiere

Das Feld „FC" in der ersten Zeile mit „CA" für CASCADE füllen.

Datenfreigabe (ENTER).

Es erscheint das CASCADE Hauptauswahlmenü Auftragsabwicklung Wertpapiere:

```
TRAN: MENU FC:    SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          H A U P T A U S W A H L

       ERFASSUNGSSTATUS                     AUFTRAGSSTATUS

       EE   ERFASSUNG GIROBEREICH BANK      AM   MATCH-DIENST
       EW   ERFASSUNG WERTEBEREICH BANK     AS   SETTLEMENT-DIENST
       ED   ERFASSUNG CBF                   AI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK
       EA   AENDERUNG/LOESCHUNG GIROBER.    AA   AENDERUNG/LOESCHUNG
       EB   AENDERUNG/LOESCHUNG WERTEBER.   AR   RESERVIERUNGS-DIENST
       EI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK        AC   SELBSTBESICHERUNG
       EK   KONTROLLE GIROBEREICH           AN   NOTFALL-DIENST
       EC   KONTROLLE WERTEBEREICH

       BOERSENGESCHAEFTSABWICKLUNG

       LS   SETTLEMENT BEARBEITUNG
       LA   AENDERUNG/LOESCHUNG
       LI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK

-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79073OU -- 19/11/14 -- 12:45:06 --

KV0005I Funktion beendet, bitte wählen Sie aus
```

Sie können nun den Funktionscode der gewählten Anwendung eingeben (z. B. „EE" für die Erfassung von Aufträgen).

2.3.4.2 (B) CASCADE-Dienste

Das Feld „FC" in der ersten Zeile mit „CK" für CASCADE-Dienste füllen.

Datenfreigabe (ENTER).

Es erscheint das CASCADE-Dienste Hauptauswahlmenü:

```
TRAN: MENU FC:    SB:

CBF-DIENSTE                H A U P T A U S W A H L

    DEPOT                                GELDKONTROLLE
    DU   UMSAETZE                        GK   ZENTRALBANK-GELD (EURO RTS)
    BA   BESTAND                         GC   COMMERCIAL BANK MONEY (CBM)
    AB   BATCH-LISTEN DEPOTBESTAND

    GELD INFORMATION                     KADI-INFORMATION
    CF   CASH FORECAST                   GI   DISPOSITION UND ABRECHNUNG
    AA   KONFIGURATION CASH FORECAST
    CI   CASH INFORMATION

    ALLGEMEINE INFORMATIONEN
    AV   VEROEFFENTLICHUNGEN




-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B793058R -- 19/11/14 -- 14:17:02 --
```

SY0096A BITTE WAEHLEN SIE AUS

Sie können nun den Funktionscode der gewählten Anwendung eingeben (z. B. „DU" für die Anzeige von Depotumsätzen).

2.3.4.3 (C) CASCADE – Auftragsabwicklung Geld

Das Feld „FC" in der ersten Zeile mit „CG" für CASCADE Auftragsabwicklung Geld füllen.

Datenfreigabe (ENTER).

Es erscheint das zugehörige CASCADE Hauptauswahlmenü:

```
TRAN: MENU FC:    SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG GELD     H A U P T A U S W A H L

   LIQUIDITÄTSMANAGEMENT


       GI INFORMATION SETTLEMENT           ZI INFORMATION KAPITALDIENSTE
                                              UND SONSTIGE GELDUMSÄTZE

       EE ERFASSUNG

       EA ÄNDERUNG/LÖSCHUNG


       CC CBF INTERN




-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79304E4 -- 19/11/14 -- 14:07:04 --

SY0096A BITTE WAEHLEN SIE AUS
```

Sie können nun den Funktionscode der gewählten Anwendung eingeben (z. B. „EE" für die Erfassung von Geldaufträgen).

2.3.4.4 (D) CASCADE - Dienste für Namensaktien (RS)

Das Feld „FC" in der ersten Zeile mit „CR" für CASCADE-Dienste für Namensaktien füllen.

Datenfreigabe (ENTER).

Es erscheint das CASCADE-Dienste für RS Hauptauswahlmenü:

```
TRAN: MENU FC:    SB:

 CASCADE-DIENSTE FUER RS    H A U P T A U S W A H L



                               CE   EINTRAGUNG

                               CU   UMSCHREIBUNG

                               CA   AKTIONAERSDATEN

                               CB   BESTANDSANFORDERUNG









 -- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79304E4 -- 19/11/14 -- 10:31:33 --

 SY0096A BITTE WAEHLEN SIE AUS
```

2.3.4.5 (E) Sonstige Dienstleistungen

Das Feld „FC" in der ersten Zeile mit „SO" für Sonstige Dienstleistungen füllen.

Datenfreigabe (ENTER).

Es erscheint das Hauptauswahlmenü für Sonstige Dienstleistungen:

```
TRAN: MENU FC:    SB:



                              G r u p p e  D e u t s c h e  B o e r s e


Funktionsangebot fuer den Bereich Sonstige Dienstleistungen:

CM:  CA-Spool                            MA:  Clearstream Banking, Frankfurt
                                              Message Administration

DI:  Online-Nutzer-Information           PR:  Anzeige Benutzerprofil

                                         TA:  TARGET - Payment Administration




-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79304E4 -- 19/11/14 -- 14:08:07 --

SY0096A BITTE WAEHLEN SIE AUS
```

2.3.5 Abmelden vom Online-System

Und so können Sie sich aus der Anwendung *„abmelden"*:

Rückkehr vom CASCADE Hauptauswahlmenü zum Einstiegsmenü der Gruppe Deutsche Börse durch Betätigen der Taste PF11.

Es erscheint das Einstiegsmenü der Gruppe Deutsche Börse.

Im Einstiegsmenü ist der Transaktionscode „MENU" (vgl. das Feld TRAN:) durch „/RCL" zu überschreiben.

Datenfreigabe betätigen.

Das erfolgreiche Verlassen des Systems wird durch das Erscheinen des Begrüßungsbildschirms der Gruppe Deutsche Börse dokumentiert.

Einen Hinweis zum Verlassen des Online-Systems IMS finden Sie immer in der Zeile 20 auf dem Einstiegsmenü der Gruppe Deutsche Börse.

2.3.6 Allgemeingültige Feldeingaberegeln

2.3.6.1 Felddefinitionen:

Falls eine Eingabe nicht die maximale Anzahl von Stellen umfasst, die für dieses Feld vom Programm zugelassen ist, kann die Eingabe wahlweise linksbündig, rechtsbündig oder in der Mitte des Feldes erfolgen. Jede Eingabeform wird vom Programm verarbeitungsgerecht aufbereitet (numerische Felder = rechtsbündig; alphanumerische Felder = linksbündig).

Die Eingabe führender Nullen bei den Vorkommastellen und abschließender Nullen bei den Nachkommastellen ist möglich, aber nicht erforderlich.

Die Eingabe des Kommas ist nur erforderlich, wenn Nachkommastellen eingegeben werden.

Bei der Eingabe von Nachkommastellen ist die Eingabe mindestens einer Stelle vor dem Komma erforderlich, ggf. einer „0".

Beispiel:

0,11	richtig
,11	falsch

2.3.6.2 Datumseingaben

Folgende Datumseingaben werden akzeptiert:

TTMM:	1406
TT.MM:	14.06
TTMMJJ:	140609
TT.M.JJ:	14.6.09
TT.MM.JJ:	14.06.09
TTMMJJJJ:	14062009
TT.MM.JJJJ:	14.06.2009

Von der Anwendung wird das eingegebene Datum in der Form „TT.MM.JJJJ" aufbereitet.

2.3.6.3 Änderung eines Feldinhaltes

Die Änderung eines angezeigten Feldinhaltes ist durch Überschreiben möglich. Nicht überschriebene Stellen der Anzeige müssen gelöscht werden.

2.3.6.4 Löschung eines Feldinhaltes

Zur Löschung eines angezeigten Feldinhaltes existieren folgende Möglichkeiten:

- den Cursor an der ersten Stelle des Feldes positionieren und die Taste „ENDE" („END") betätigen (Löschung des gesamten Feldes),
- den Cursor an der ersten Stelle des Feldes positionieren und die Taste „ENTF" („DEL") betätigen (Löschung Zeichen für Zeichen).

2.3.6.5 Anzeige Fehlermeldungen

Bei fehlerhaften Feldeingaben werden in der Zeile 24 auf Ihrem Bildschirm Fehlermeldungen angezeigt.

2.3.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
AA AUFTRAGSART	Auftragsart	2-stellig numerisch	***	Numerisches Kennzeichen für eine CASCADE Auftragsart. Folgende Ausprägungen sind möglich: 01 = WP-Übertrag / Depotübertrag RS / Bestandsübertrag RS / Emissionseinführung RS / CCP-OTC-WP-Übertrag 02 = Match-Instruktion / Emissionseinführung RS / CCP-Instruktion 03 = BSV-LSV-Übertrag jetzt: BWV 04 = Verpfändung * 05 = Freigabe * 07 = GBC-Umtausch 09 = GBC-Rücktausch 10 = Lieferbestand * 11 = WP-Leihauftrag * 12 = WP-Leihe/Rückführung * 14 = Strip-Aufteilung 15 = Strip-Zusammenführung 16 = Einlieferung für Einzelurkunden / techn. Sammelurkunden, Neuzulassung / Aufstockung für Globalurkunde + Jungschein, Valutierung von variablen Globalurkunden (BIS-ZU) 17 = Optionsscheintrennung 18 = Auslieferung für Einzelurkunden/techn. Sammelurkunden Auslieferung für Globalurkunden + Jungschein Re-Valutierung von variablen Globalurkunden (BIS-ZU) 19 = Optionsscheinzusammenführung 99 = Storno/Nachbuchung Depotumsatz * Mit Einsatz CCP nur noch für non-CCP-Geschäfte.
ABR.BETRAG	Abrechnungs-Betrag	13,2-stellig numerisch	keine	Wird in der Vollanzeige eines Börsenumsatzes angezeigt: Abrechnungsbetrag eines Geschäftes.
AKTIONÄRS-NUMMER	Aktionärsnummer bei Namensaktien	10-stellig	***	Hier wird die Aktionärsnummer angezeigt. Diese Nummer wird nur durch den Emittenten vergeben.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
AKTUELLER KURSWERT	aktueller Kurswert	13,2-stellig numerisch	keine	Aktueller Kurswert der Wertpapiere auf einem Depot.
ALPHA VON (BIS)	Alpha von (bis)	15-stellig alphanum.	muss	Durch eine alphabetische Eingabe in die Felder „ALPHA VON" und "BIS" kann für den unter „KV/CL" (vgl. Feld KV/CL) angegebenen Clearing-Partner eine Eingrenzung vorgenommen werden.
ALREADY MATCHED	Bereits gematched	J/leer	keine	Dieses Feld wird zurzeit noch nicht verwendet.
ANZ K/V	Anzeige Kurz-/Vollanzeige	1-stellig alphanum.	muss	Wahlmöglichkeit zwischen Kurz- oder Vollanzeige
ANFORDERUNG	Anforderung	12,2-stellig numerisch	muss	Geldbetrag, der im Rahmen des Neuen Abwicklungsmodells jeweils für die Standardverarbeitung bei der Deutschen Bundesbank angefordert bzw. reserviert werden soll.
AUFTRNR AUFTRAGSNR AUFTNR A-NR GEGEN-AUFTRNR	Auftragsnummer	1-7-stellig numerisch	muss	Eindeutigkeit je Eingeber muss systemseitig vorliegen. Von den Systemnutzern kann eine 7-stellige Nummer zwischen 1 und 6999999 frei vergeben werden. Automatisch generierte Aufträge aus Umlegungen und Stornos erhalten Auftragsnummern zwischen 8000000 und 9499999. CCP Aufträge erhalten eine 7-stellige Nummer zwischen 7000000 und 7999999.
AUFTRAGS-REFERENZ	Auftragsreferenz	16-stellig alphanum.	keine	Dieses Feld enthält die Auftrags-Nummer eines Clearinghaus-/CSD-Teilnehmers im Clearinghaus- bzw. CSD-System und CCP Geschäftsnummer.
AUSM. BETRAG (LION)	Ausmachender Betrag	13,2-stellig numerisch	keine	Der ausmachende Betrag versteht sich ohne Kursdifferenz.
AUSWERTUNG	Auswertung	1-stellig alphanum.	muss	Hier kann eine Terminierung der Listanforderung vorgenommen werden.
BANK	vgl. Last-/Gut-Bank			
BANK-IGSNR	Bankinterne Geschäftsnr.	5-stellig numerisch	keine	Wird in der Vollanzeige eines Börsenumsatzes angezeigt.
BANK-IKZ	Bankinternes Kennzeichen	2-stellig alphanum.	keine	Wird in der Vollanzeige eines Börsenumsatzes angezeigt.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
BANK-NUMMER (CASCADE)	Banknummer	4-stellig numerisch	muss	Kontostammnummer
BANK-NUMMER (LION)	Banknummer	4-stellig numerisch	kann	Kontonummer der Zentrale oder Niederlassung. Ist diese Feld nicht gefüllt, so wird für die Verarbeitung die Banknummer aus der User-ID herangezogen (Ausnahme: CBF). Die Zentrale kann bis zu 16 Filialen im REG-ÜBER Verfahren direkt bearbeiten. Sind weitere Filialen vorhanden, so wird das Feld zum Muss-Feld.
BANK-NR DES KONTRAHENTEN	Bank-Nr. des Kontrahenten	4-stellig numerisch	***	Kontostammnummer des Kontrahenten
BATM/ADEA	Nutzung des BATM Services	J/N	keine	Eine Eingabe ist in diesem Feld zurzeit noch nicht möglich. Vorbelegt mit „N“ = NEIN.
BEGUENSTIGTER-NAME	siehe auch AA Rücktausch GBC			Name einer Drittbank oder eines Brokers, an den die Lagerstelle der CBF die Wertpapiere zu liefern hat.
BELEGSCHAFTS-SP	Belegschaftssperre	J/N	muss	Sperrdatum bei der Übertragung von Belegschaftsaktien
BESTÄTIGUNG	Bestätigung	12,2-stellig numerisch	keine	Bestätigung der Deutschen Bundesbank über den Geldbetrag, der für die Standardverarbeitung im Rahmen des Neuen Abwicklungsmodells tatsächlich reserviert wurde.
BOERSEN-TLN	Börsen-Teilnehmer	2-stellig numerisch	***	Durch die Angabe des Feldes Börsen-Teilnehmer kann die tabellarische Anzeige (TRAN:KVAV, FC:II) selektiert werden. (vgl. Band 2, Abschnitt 7.2)
BOERSENPL	Börsenplatz	4-stellig alphanum.	keine	Dieses Feld wird zurzeit noch nicht verwendet.
BUCHUNGEN siehe Buchungszeilen				Hier wird die Anzahl der ermittelten Zusatzbuchungen angezeigt.
BUCHUNGS-ZEILEN	Buchungszeilen		keine	Hier werden die automatisch gebildeten Umsätze angezeigt.
DCA/REF	DCA / DCA Referenz	DCA: 34-stellig alphanumerisch / REF: 7-stellig numerisc	keine	Dieses Feld wird zurzeit noch nicht verwendet.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
		h		
DEPOTBUCH-BESTAND	Depotbuchbestand	15,3-stellig numerisch	keine	Depotbuchbestand pro WKN und KONTO
DISPO-PRIORITAET	Dispositions-Priorität	1-stellig numerisch	muss	Durch Nutzung dieses Kennzeichens kann die Priorität eines Auftrages in der Disposition gesteuert werden (siehe Band 1, Abschnitt 0)
DISPOSITIONS-BESTAND	Dispositionsbestand	15,3-stellig numerisch	keine	Dieses Feld wird wegen der sofortigen Finalität der Wertpapiertransaktionen nicht mehr benötigt und daher nicht mehr befüllt.
DISPOSITIONS-SALDO	Dispositionssaldo	15,3-stellig numerisch	keine	Dieses Feld wird wegen der sofortigen Finalität der Wertpapiertransaktionen nicht mehr benötigt und daher nicht mehr befüllt
CBF-INTERNATIONAL LAG	Lagerstellenkonto (CBF-LAG)	3-stellig	keine	In diesem Feld wird die CBF interne Kennung und der Name der Lagerstelle für die sich im Ausland befindliche Original-WKN zu einer GBC-GS-WKN angezeigt. Beide Informationen werden vom System nach ENTER hinzugefügt.
CBF-TLN	Kunde der CBF	1-stellig alphanum.	***	Durch die Angabe des Feldes TLN kann mit 1 bzw. „N" = NEIN (Kein Kunde der CBF) oder 2 bzw. J (Kunde der CBF) die tabellarische Anzeige (TRAN:KVAV; FC:II) eingeschränkt werden.
EUREX-TLN	Eurex-Teilnehmer	1-stellig alphanum.	***	Durch die Angabe des Feldes EUREX-Teilnehmer (Derivate Markt) kann die tabellarische Anzeige (TRAN:KVAV, FC:II) selektiert werden.
EINHEIT	Einheit	2-stellig	keine	Depotwährung (z. B. „ST", „EUR").
EMISS-EINF	Emissions-Einführung	J/N	***	Primary Market Abwicklungs-Kennzeichen. Für CASCADE RS-Aktien Muss-Information.
EMPF	Empfänger	4-stellig num.	muss	Banknr. des Empfängers bei der Anforderung einer Bestandsauswertung.
EMPF-P1	Empfänger Settlement Party 1		keine	Eine Eingabe ist derzeit noch nicht möglich. Falls vorhanden, wird der dem entsprechenden Gut-/Last-Konto zugeordnete SAC angezeigt.
EMPF-P2	Empfänger Settlement Party 2	BLZ/BIC/ KTO/TXT	***	Auflistung einer zusätzlichen, hinter dem instruierenden Konto stehenden Partei. BLZ (8 Stellen numerisch) BIC (ohne Leerzeichen 8- oder 11-stellig/alphanumerisch)

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				KTO bis zu 35 Stellen alphanu-merisch KTO MSC-NONREF (falls andere Angaben nicht bekannt; Hinweis: der ID-Type MSC wird nicht mehr unterstützt, daher muss die Eingabe mit ID-Type KTO oder ACC und Feldinhalt "MSC-NONREF" vorgenommen werden) TXT mit bis zu 70 Zeichen Freitext
EMPFANG-DATUM	Empfangsdatum	TT.MM.JJ	muss	Empfangs- und Verarbeitungsdatum der File Transfer-Blöcke
ERFASSER	Erfasser	4-stellig numerisch	muss	Über das Feld wird festgelegt, wer die Listanforderung bearbeitet. Das Feld wird vorbelegt mit den ersten 4 Stellen des ID-Kennzeichens.
ERWERBSPREIS	Erwerbspreis	10,2-stellig numerisch	kann	Der ausmachende Betrag ist hier einzugeben zuzüglich der Währungsangabe EUR.
ERWERBSTAG	Erwerbstag	TT.MM.JJ	kann	Hier ist der Valuta-Tag einzutragen.
EXT-SET-DAY	Externer Settlement-Day	TT.MM.JJ	kann	Die zwischen den externen Teilnehmern (=Dritte) gültige Buchungsvaluta.
ERWORBEN / VERW.	erworben / verwahrt	J/N	kann	In diesem Feld ist einzutragen, inwiefern das übertragende Institut die Wertpapiere für den Kunden erworben bzw. nur verwahrt hat.
EX TRD	EX Kennzeichnung für Market Claim Verarbeitung	J/N	kann	In Abhängigkeit von bilateralen Eingaben können OTC-Transaktionen von den Kontrahenten unabhängig vom Handelsdatum als Ex ausgewiesen werden. Wenn beide Kontrahenten die Kennzeichnung mit dem Wert J füllen, wird die Transaktion ungeachtet des Handelsdatums als Ex-Transaktion behandelt. Market Claims werden dann nicht ausgeführt, beziehungsweise Reverse Claims werden ausgeführt. Sollte die Eingaben nicht übereinstimmen (d. h. eine Partei setzt die Kennzeichnung auf BLANK und die andere auf J, oder eine der Partien lässt das Feld leer), wird die Kennzeichnung nicht berücksichtigt und das Handelsdatum ist anwendbar.
GEGEN-AUFTNR	Gegenauftragsnummer	7-stellig numerisch	kann	In diesem Feld kann für die AA 01 /02 die jeweilige Kontrahenten CASCADE Auftragsnummer eingestellt werden. Diese kann ein Direct-Matching einer

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				MA/MI bewirken.
GELDVERR	Geldverrechnung	Textfeld	keine	Hier erscheint ein Hinweis, ob ein automatischer Kontoausgleich bei EURO durchgeführt wurde.
GELDKONTO	Geldkonto	7-stellig numerisch	***	CBF-internes bestandsloses Verrechnungskonto für Kunden im Rahmen des neuen Abwicklungsmodells, welches als Spiegelkonto zum bei der Bundesbank geführten Bestandskonto geführt wird.
GESNR (LION)	Geschäftsnummer	max. 7-stellig numerisch ≠ 0	***	Geschäftsnummer eines Börsengeschäftes
G-KONTO	Gegenkonto	7-stellig numerisch	kann	Gegenkonto zu der unter KONTO eingegebenen Nummer
GUT-BANK	Gutschrift-Bank	4-stellig numerisch	***	Hauptkonto des Begünstigten (= Habenkonto)
GUT-KONTO-RTS	Gutschriftkonto-Bank Identifier Code	11-stellig alphanumerisch	keine	BIC des Gut-Kontoinhabers bei der Bundesbank (RTGS-Konto)
GUT (CASCADE)	Gutschrift-Konto	7-stellig numerisch	muss	Hauptkonto und Unterkonto des Begünstigten Nach ENTER wird vom System die Kontobezeichnung hinzugefügt.
HLG	Hinterlegungsart CBF	2-stellig numerisch	muss	Dieses Feld orientiert sich an der internen Verwahrart der CBF für die jeweilige WKN. Folgende Ausprägung ist derzeit möglich: 01 = „GS“ (Girosammelverwahrung) Nach ENTER wird vom System die Bezeichnung hinzugefügt.
MARKT	Internationale Märkte mit einem aktiven Settlement Link zu Clearstream Banking AG, Frankfurt	2-stellig numerisch	muss	Angabe einer MARKT-Nummer oder "A" für alle (nur bei Alphasuche) folgende Ausprägungen sind für CASCADE-Aufträge möglich: 01= CBF GERMANY CBF 02= OEKB AUSTRIA OEKB 03= EFR ESES FR 06= CBL INV CBL AS INVESTOR 07= EOC EUROCLEAR 10= MONTE TITOLI ITALY MT.TITOLI 11= DTCC USA DTCC 16= EFI FINLAND EFI

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				20= VP DENMARK VP 25= IBERCLEAR SPAIN IBERCLEAR 26= HELEX GREECE HELEX 33= ESES FR ESES FR 34= ESES NL ESES NL 35= ESES BE ESES BE 46= SIS CUSTODIAN SWISS SIS CUSTODIAN 60= CBL ISS CBL AS ISSUER 90= SIS SWISS SIS
ID AENDERUNG / ID-LOESCHUNG	Identifizierungs-Kennzeichen zur Änderung bzw. Löschung	10-stellig numerisch	keine	User-ID des Benutzers, der einen Auftrag zur Änderung bzw. Löschung markiert hat.
ISO TRANSACTION CODE	ISO Transaction Code	Gemäß ISO 15022 / 20022	keine	Dieses Feld wird zurzeit noch nicht verwendet.
KENNZEICHEN KAUF / VERKAUF (K/V)	Kennzeichen Kauf / Verkauf (LION)	1-stellig alphanum.	muss	Die Bearbeitung und Anzeige von Börsengeschäften wird unterschieden nach der Käufer- und Verkäuferseite. Dieses Kennzeichen bestimmt, für welche Seite die Verarbeitung bzw. Anzeige erfolgen soll. Folgende Ausprägungen sind möglich: „K" = Kauf „V" = Verkauf
KE-DATUM	Datum bei bedingter Kapitalerhöhung	TT.MM.JJJJ	muss	Angabe nur bei WP-Überträgen in RS WKN als Emissionseinführung
KONTO	Konto	7-stellig numerisch	muss	vgl. LAST / GUT
KONTO-RTS	Bank Identifier Code	11-stellig alphanumerisch	keine	RTGS-Konto des Gut- bzw. Last-Kontoinhabers im Eurosystem
KONTROLL-KENNZEICHEN	Kontroll-Kennzeichen	1-stellig alphanum.	muss	Dies Feld ist in der Funktion „Kontrolle" vom Kontrolleur zu füllen. Die verschiedenen möglichen Kennzeichen finden Sie im Kapitel: Funktionen Erfassungsstatus
KTO / TLN-NR	Konto- bzw. Teilnehmer-Nr.	n-stellig numerisch.	muss	Angabe einer 4-stelligen Banknummer, wenn es sich um einen Teilnehmer bei der CBF handelt oder einer n-stelligen Nummer, wenn es sich um einen

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				CSD/ICSD handelt.
KUNDEN-REFERENZ	Siehe auch Band 1, Abschnitt 2.3.8.2 sowie die einzelnen Auftragsarten		***	In diesem Feld kann der Auftraggeber bzw. Begünstigte Informationen zum Original-Auftraggeber oder Endbegünstigten spezifizieren. Bei den Auftragsarten Bestands-, Depotübertrag und WP-Übertrag mit Emissionseinführung identifizieren die Angaben in diesem Feld Instituts und/oder Depotnummer des Aktionärs.
KURS / WRG	Kurs und Währung	Kurs: 6,4-stellig numerisch; Währung: 3-stellig alphabetisch	kann	Der von den Endteilnehmern vereinbarte Kurs mit der dazugehörigen Währung.
KURSDI (LION)	Kursdifferenz	7,2-stellig numerisch	keine	Die Kursdifferenz wird in der Vollanzeige gebuchter Depotumsätze angezeigt.
KZ	Kennzeichen-spalte	1-stellig alphanum.	kann	Zu den verschiedenen möglichen Kennzeichen vgl. die Vorgänge in den Kapiteln: Funktionen Erfassungsstatus, Auftragsstatus, Börsengeschäftsabwicklung
KZ-AA	Zusätzliches internes CBF Kennzeichen für OTC-Auftragsarten	1-stellig alphabetisch	muss	Art eines WP-Übertrages. Es sind folgenden Ausprägungen möglich: A = CCP-Surplus Delivery Auftrag B = Bestandsübertrag (RS) C = XEMAC-Auftrag E = Emissionseinführung (RS) P = Depotübertrag (RS) S = CSD SE-Trade
LAST (CASCADE)	Lastschrift-Konto	7-stellig numerisch	muss	Hauptkonto und Unterkonto des Auftraggebers. Nach ENTER wird vom System die Kontobezeichnung hinzugefügt.
L / G	Lastschrift / Gutschrift	L / G	keine	Anzeige eines Last – oder Gutschriftauftrages
LAST-BANK	Lastschrift-Bank	4-stellig numerisch	***	Hauptkonto des Auftraggebers (= Sollkonto)
LAST-KONTO-RTS	Lastschriftkonto -Bank Identifier Code	11-stellig alphanumerisch	keine	BIC des Last-Kontoinhabers bei der Bundesbank.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
LKZ	Länderkenn-zeichen	3-stellig alphanum.	muss (vorbelegt)	An dieser Stelle muss das Länderkennzeichen des Begünstigten bei einem SV-Übertrag angegeben werden (AA 03).
LZB-ENDSALDO	LZB-Endsaldo	14,2-stellig numerisch	keine	Hier wird der Endsaldo der letzten Bundesbank-Verrechnung (in Euro) angezeigt.
MATCH-STATUS M	Match-Status	2-stellig numerisch 1-stellig numerisch	keine	Informations-Kennzeichen für den Match-Status eines Auftrages. Ausprägungen, siehe Band 2 Abschnitt 7.2.
NAME 1 / VORNAME 1	Name / Vorname	Textfeld	muss	Name und Vorname des Schuldbuchkonto-Inhabers bzw. bei Neueinträgen Name und Vorname des Begünstigten
NAME 2 / VORNAME 2	Name / Vorname	Textfeld	kann	Bei Gemeinschaftskonten sind hier Name und Vorname des 2. Kontoinhabers einzutragen.
NOMINALE (CASCADE und LION)	Nominale / Nennwert	10,3-stellig numerisch 12,3-stellig	muss	Der zwischen den Kontrahenten zu buchende Depot-Nominalbetrag
OPT-OUT	Opt-Out für einen laufenden Market Claim / Reverse Claim Prozess	J/leer	keine	Dieses Feld wird zurzeit noch nicht verwendet.
ORTS-KENNZEICHEN	Orts-Kennzeichen (Börsenplatz)	1-stellig alphanum.	muss	Durch die Angabe des Feldes Orts-Kennzeichen wird die tabellarische Anzeige (TRAN:KVAV, FC:II) entweder für die CBF und ihre Filialen (A) oder für einen spezifischen Platz ausgegeben.
ORT	Ort	Textfeld	muss	BSV/LSV-Übertragung ergänzende Personendaten jetzt: Deutsche Finanzagentur (AA03).
P1	Settlement Party 1		***	Bei Kontrahenten im Inland wird, falls vorhanden, der dem entsprechenden Gut-/Last-Konto zugeordnete SAC angezeigt. Bei Kontrahenten im Ausland ist eine Eingabe erforderlich. Erstes Feld: BIC (ohne Leerzeichen 8- oder 11-stellig/alphanumerisch) Zweites Feld: Kontonummer
P2 – P5	Settlement	BLZ/BIC/	***	Auflistung zusätzlicher, hinter dem

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
	Party 2-5	KTO/TXT		instruierenden Konto stehenden Parteien. BLZ (8 Stellen numerisch) BIC (ohne Leerzeichen 8- oder 11-stellig/alphanumerisch) KTO bis zu 35 Stellen alphanu-merisch, Prüfung bei Geschäften ge-gen CSDs oder ICSDs gegen Kunden-stammdatendatei KTO MSC-NONREF (falls andere Angaben nicht bekannt; Hinweis: der ID-Type MSC wird nicht mehr unterstützt, daher muss die Eingabe mit ID-Type KTO oder ACC und Feldinhalt "MSC-NONREF" vorgenommen werden) TXT mit bis zu 70 Zeichen Freitext pro Feld
PARTIAL SETTL INDICATOR	Partial Settlement Indicator	NPAR/PART/PARQ/PARC	keine	Dieses Feld wird zurzeit noch nicht verwendet.
PERSON	Kennzeichen Person	1-stellig alphanum.	***	Durch dieses Kennzeichen muss der Begünstigte bei einem "NEUEINTRAG" in das Bundesschuldbuch angeben, ob eine natürliche oder eine juristische Person ein neues Schuldbuchkonto eröffnen möchte (AA03).
PLZ	Postleitzahl	5-stellig numerisch	muss	Bei Ortsangaben
PRIMANOTE PNP	Primanote	1-3-stellig numerisch	kann	Der Kunde der CBF kann hier mehrere Aufträge unter einer von ihm selbst vergebenen Ordnungsnummer verwalten (Stapelerfassung). Für die Korrektheit dieser Nummer ist der Teilnehmer selbst verantwortlich, da systemseitig keine Überprüfung erfolgt.
REFERENZ-NR	Referenz-Nummer (WP-Überträge)	16-stellig alphanum.	kann	Hier kann die zwischen den Kontrahenten vereinbarte (WP-Übertrag) Auftragsbezugsnummer eingetragen werden.
REG-UEBER	Reg-Über	1-stellig alphanum.	***[1]	Durch Angabe des Feldes kann die tabellarische Anzeige (TRAN:KVAV, FC:II) auf N (Liste aller Niederlassungen mit Zentrale), Z (Liste aller Zentralen mit Niederlassungen) oder S (Liste aller Stammsitze mit Niederlassungen) eingeschränkt werden.

** numerisch oder alphanumerisch, hängt von der jeweiligen Eingabe ab.

*** Muss- oder Kannfeld kann nicht eindeutig festgelegt werden, sondern hängt vom jeweiligen Vorgang ab

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
RUECK-UEBERTRAG	Rückübertrag	J/N	muss	Wenn ein früherer Auftrag direkt zwischen den Teilnehmer „storniert" werden soll.
RTGS – Konto	RTGS - Konto	11-stellig alphanumerisch	Keine	Kontenbezeichnung für registrierte Bundesbank-Konten im Eurosystem bzgl. der Geldverrechnung im Rahmen des TARGET2 Systems
SALDO-VORTRAG	Saldovortrag	14,2-stellig	keine	Im diesem Feld wird der Saldo aus der Bundesbank-Verrechnung angezeigt.
SCHLUSSTAG	Schlusstag	TT.MM.JJ	muss	Der Tag, an dem die Endteilnehmer das WP-Geschäft/Börsengeschäft abgeschlossen haben (Trade-date).
RTS	Art der Regulierung	J/N	muss	Folgende Ausprägungen sind möglich: J für RTS mit Gegenwert EUR (Sofortdisposition) N für STD und SDS- Batch-verarbeitung (Massendisposition) und Cont-SDS
SET-DAY SET-D	Settlement-Day	TT.MM.JJJJ	muss	Buchungstag, zu dem Wertpapier- und Geldregulierung erfolgen soll (Wenn der Eingeber dies Feld nicht gefüllt hat, erfolgt eine automatische Voreinstellung der nächstmöglichen Buchungsvaluta). *Bedingung:* Settlement-Day muss kleiner oder gleich dem Tagesdatum oder Tagesdatum + 40 Bankarbeitstage sein
PARTY-HOLD (CASCADE)	Settlement-Sperre	J/N	muss	Kennzeichen, ob ein Auftrag mit einer Settlement-Sperre versehen werden soll
SETTLEMENT-SPERRE (LION)	Settlement-Sperre	1-stellig alphanum.	***	Kennzeichen, welches das gewählte Freigabe-Verfahren (Positiv / Negativ) bzw. den Verarbeitungsstatus des Börsengeschäftes widerspiegelt Folgende Ausprägungen sind möglich: S = Gesperrte Geschäfte F = Freigegebene Geschäfte L = Von mindestens einer Seite zur Löschung markierter Geschäfte A = Keine Einschränkung in Bezug auf Settlement-Status oder Lösch-Status
PRTYHLD-STATUS	Settlement-Status	1-stellig numerisc	keine	Informations-Kennzeichen für den Settlement-Status eines Auftrages (vgl.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
	(Kurzanzeige)	h		Band 2, Abschnitt 7.2)
SP-DATUM	Sperr-Datum	TT.MM. JHJJ	kann	Dieses Feld ist bei der Übertragung von Belegschaftsaktien innerhalb der entsprechenden Sperrfrist zu füllen.
ST-ART	Stückeart	20-stellig alphanum.	keine	Gattungsspezifische Hinterlegungsart von Wertpapieren (z. B. Mantel und Bogen, Unikate, nur Mantel).
ST-ZINS	Stückzins	6,2-stellig numerisch	kann	Dieses Feld ist bei der Übertragung an die Bundes- und Landesschuldenverwaltung zu füllen. Zuzüglich die Währung EUR.
STRASSE	Straße	Textfeld	muss	
STRIPPING-FORM	Stripping-Form	2-stellig alphanum.	keine	Angabe, in welcher Form eine Anleihe aufgeteilt werden soll: 2 = Trennung cum-Anleihe in Mantel / Kupons
SV-KONTO	SV-Konto	7-stellig numerisch / 10-stellig alphanum.	muss	Eingabe der 7-stelligen Schuldbuch-Kontonummer, die mit 0, 1, 3, 4, 6, 8 oder 9 beginnen muss. Sofern für den Begünstigten noch kein Schuldbuch-Konto besteht, ist "NEUEINTRAG" in das Feld einzugeben.
SWIFT-ADRESSE SWIFT-ADR	SWIFT-Adresse	12-stellig alphanum.	***	Angabe einer gültigen SWIFT-Adresse
TAG DER GELD-VERRECHNUNG	Tag der Geldverrechnung	TT.MM.JHJJ	muss	Auswahlkriterium im Rahmen der Geldvorabinformationsanzeige.
TEIL-NOMINALE (LION)	Teilnominale	12,3-stellig numerisch	kann	Angabe eines Teilbetrages der Nominale, in der ein Börsengeschäft beliefert werden soll.
TEXT	Text	Textfeld	kann	Hier können zusätzliche Informationen für den Begünstigten eingetragen werden.
TR	Teilrechte Umwandlung von Teilrechte in Vollrechte bzw. Umwandlung von Vollrechte in Teilrechte oder Umwandlung von Aktienspitzen/Aktienanrechten in Originalaktien	1-stellig numerisch	kann	Bei der Umwandlung von Teilrechte- in Vollrechte-Wertpapierbestände oder von Vollrechte- in Teilrechte-Wertpapierbestände sind folgende Ausprägungen möglich: 1 = Teilrechte in Vollrechte 2 = Vollrechte in Teilrechte. (Vollrechte in Namensaktien (RS) werden immer über den freien Meldebestand mit KE-TYP gebucht. Bei der Umwandlung von Aktienspitzen/Aktienanrechten in Originalaktien oder von Originalaktien in Aktienspitzen/Aktienanrechten sind

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
	bzw. von Originalaktien in Aktienspitzen/Aktienanrechten *Bei Namensaktien (RS) wird immer über den freien Meldebestand ohne KE-TYP gebucht.			folgende Ausprägungen sind möglich: 3 = Spitzen/Anrechte in Originalaktien* 4 = Originalaktien* in Spitzen/Anrechte 5 = Spitzen/Anrechte in Originalaktien* 6 = Originalaktien* in Spitzen/Anrechte
TRADE-DATE	Trade-Date Schluss-Tag Handelstag	TT.MM.JJ	muss	Tag, an dem ein Geschäft abgeschlossen wurde (Schlusstag oder Handelstag).
UEB-GRUND UEB-G	Übertragungs-grund 1 WP-Übertragungen	3-stellig numerisch	kann	Es sind folgende Ausprägungen möglich: 101 = OTC-Geschäftsbelieferung (DvP) 102 = OTC-Geschäftsbelieferung (FOP) 103 = Realignment 104 = Lieferung für Kundendepot 200 = ESES FoP ohne Matching 201 = Repo mit Gegenwert 202 = Repo ohne Gegenwert 203 = Repo (open) 204 = Repo (return) 210 = Iberclear Loan Opening in SCLV 211 = Iberclear Loan Closing in SCLV 212 = Iberclear Collateral transfer e.g. CCBM 213 = Iberclear transfer without change of ownership 220 = CBL Non-CSD Transfer 221 = EOC FIN Transfer Empty = Iberclear transfer with change of ownership or EOC FIN Transfer or ESES FoP with Matching 301 = Wertpapierleihe mit Gegenwert 302 = Wertpapierleihe ohne Gegenwert 303 = Securities Lending (open) 304 = Securities Lending (return) 401 = Neuemission/IPO 501 = Corporate Action UM 502 = Corporate Action KE

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				503 = BR-Ausübung 504 = BR-Handel 505 = Angebote 506 = OS-Ausübung 507 = OTC Kompensation 508 = SE Lion Kompensation 509 = Storno OTC Kompensation 510 = Storno SE Lion Kompensation 511 = OTC Reverse Claim 512 = Lion Reverse Claim 513 = Storno OTC Reverse Claim 514 = Storno Lion Reverse Claim 515 = Corporate Action TI 601 = Others 701 = Collateral (open) 702 = Collateral (return) 901 = Rejection/Storno 950 = Nur DTCC Transfers mit Reason Code 280 951 = Nur DTCC Transfers mit Reason Code 290 952 = Nur DTCC Transfers mit Reason Code 040 953 = Nur DTCC Transfers mit Reason Code 098
UEBERTRAG-ART	SV-Übertragungs-art für Übertragungen von bzw. an Deutsche Finanzagentur	1-stellig numerisch	muss	Kennzeichen für die Richtung der Schuldbuchforderungsübertragung (Übertrag in Einzel- oder Sammelschuldbuchforderung). Folgende Ausprägungen sind möglich: 1 an SV = Einzelschuldbuchforderung 2 von SV = Sammelschuldbuchforderung
UMSATZART	Umsatzart	1-stellig alphanum.	***	Folgende Ausprägungen sind möglich: L = Lastschrift G = Gutschrift
UMSATZ-RESERVIERUNG	Umsatzreservierung	15,3-stellig alphanum.	keine	Bestände, die für RTS-Geschäfte mit Gegenwert reserviert wurden.
URSPRUNG. NOMINALE (LION)	Ursprungsnominale	12,3-stellig numerisc	keine	Ursprünglich abgeschlossene Nominale vor Belieferung einer Teilnominale

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
		h		
VA	Verarbeitungsstatus	1-stellig alphanum.	keine	Anzeige des Verarbeitungsstatus der Erträgnisbeträge bei der Geldvorabinformation. Es sind folgende Ausprägungen möglich: V = Vorabinformation zu den Erträgnisdaten E = Endgültige Erträgnisdaten
VALUTA, VALUTAZEITRAUM	Valuta	TT.MM.JHJJ	***	Eingabe einzeln oder als Intervall möglich (Buchungstag bis 120 Tage historisch).
VALUTA LTE.BEW.	Valuta Letzte Bewegung	TT.MM.JHJJ	keine	In diesem Feld wird in der Depotanzeige das Datum der letzten Bewegung angezeigt
VERARB. STATUS	Verarbeitungsstatus	Textfeld	keine	Anzeige des SDS-Verarbeitungsstatus in der Gelddispositionsanzeige (Transaktion: KVUM / GU)
VERARB-STATUS	Verarbeitungs-status	3-stellig numerisch	kann	Verarbeitungsstatus der Geldüberweisungsaufträge bzw. der Widerrufe im Rahmen von RTS mit Gegenwert EUR (vgl. Band 2, Abschnitt 7.2)
VERR. AUS GELD-KONTO-1	Verrechnung aus der Abenddisposition	14,2-stellig numerisch	keine	Anzeige des Bundesbank Verrechnungssaldos aus der abendlichen Disposition des Vortages
VERR. AUS GELD-KONTO-2	Verrechnung aus der Same-Day-Settlement-Disposition	14,2-stellig numerisch	keine	Anzeige des Bundesbank Verrechnungssaldos aus der letzten Same-Day-Settlement-Disposition in EURO.
VERWENDUNGS-ZWECK	Verwendungs-zweck	10-stellig numerisch	kann	Wichtiges Zuordnungskriterium im Rahmen von RTS mit Gegenwert Euro. Setzt sich aus der CBF-Nummer des Eingebers der Match-Instruktion (4-stellig) sowie der Auftrags-Nr. der Match-Instruktion (7-stellig) zusammen.
VS VERARB-STATUS	vgl. Ver-arbeitungsstatus			
VWA (CASCADE)	Verwahrart	2-stellig alphanum.	keine	Das Feld wird mit "GS" für Girosammelverwahrung vorbelegt und ist nicht überschreibbar.
VERWAHRART (LION)	Verwahrart	3-stellig alphanum.	***	Das Feld spezifiziert die Verwahrart für das Börsengeschäft und wird standardmäßig mit „GS" vorbelegt. Folgende Ausprägungen sind möglich:

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				GS = Girosammelverwahrung STR = Streifband AKV = CBF International (WR) WPR = Wertpapierrechnung
WAEHRUNG	Währung	3-stellig alphanum.	muss	Zugelassene Währungen in denen Geschäfte verarbeitet werden können.
WEITERLEITUNG AN	Weiterleitung an	35-stellig alphanum.	kann	An dieser Stelle kann beispielsweise eine bestimmte Empfangsabteilung beim Kunden der CBF angegeben werden.
WKN WP-KENNUNG	Wertpapier-Kennung/ ISIN	siehe Erklärung	muss	Abhängig von der Eingabe. Bei der WP-Kennung gelten für die WKN folgende Bedingungen: W = 6-stellig numerisch und größer als 100.000 I = 12-stellig alphanumerisch B = 3 bzw.4-stellig alphanumerisch F = 7-stellig numerisch D = 7-stellig alphanumerisch E = 4-stellig alphanumerisch
WKN BIS	Wertpapier-kennnummer bis	12-stellig numerisch	kann	Dieses Feld kann zur Eingrenzung eines Kennnummernkreises gefüllt werden.
WKN D. RECHTS	Wertpapier-kennnummer	6-stellig numerisch	muss	Der Kapitalerhöhungstyp bei einer Namensaktie stellt sich aus der WKN des Rechts und dem entsprechenden Ex-Tag der Maßnahme dar.
WKN-INFO (Ausgabezeile nach WKN)	Wertpapier-bezeichnung	Textfeld	keine	*Erste Zeile:* Zinssatz (bei Renten) Wertpapier-Kurzbezeichnung Zinstermin (bei Renten) *Zweite Zeile:* Gattungssperre mit Gültigkeitszeitraum Verlosungs-, Rückzahlungs- bzw. Kündigungsinformationen
WKN VON (LION)	Wertpapier-kennnummer von	6-stellig numerisch oder 12-stellig alphanum.	***	Wird dieses Feld mit einer WKN gefüllt, so beginnt die Selektion der Börsengeschäfte ab dieser Nummer
WKN VON (LION)	Wertpapier-kennnummer von	6-stellig numerisch oder	muss	Dieses Feld muss mit einer WKN gefüllt werden. Es kann auch das Börsenkürzel der Gattung eingegeben werden.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
		12-stellig alphanum.		
WP-KENNUNG	Wertpapier-kennung siehe auch WKN	1-stellig alphanum.	muss	*Eingabemöglichkeiten*: W = Deutsche WKN I = ISIN B = Börsenkürzel F = COMMON CODE Vorbelegung: I
WRG (CASCADE)	Währung Gegenwert	3-stellig	muss	Zugelassene Währungen, in denen Gegenwerte über Bankguthaben (commercial bank money) verrechnet werden können. Eingabemöglichkeiten: AUD = Australien CAD = Kanada CHF = Schweiz CZK = Tschechien DKK = Dänische Kronen EUR = EWWU GBP = Großbritannien HKD = Hongkong Dollar JPY = Japan MXN = Mexiko NOK = Norwegen PLN = Polen SEK = Schweden TRY = Türkei USD = US-Dollar ZAR = Südafrika Nähere Informationen zur Geldverrechnung in Fremdwährung können dem CBF Customer Handbook (Kapitel 4.2) entnommen werden. Bei Gegenwertverrechnung in Schweizer Franken (CHF) und Einbeziehung eines Wertpapiers mit CH-ISIN ist die Beschreibung im CBF Customer Handbook (Kapitel 4.3) zu berücksichtigen.
WAEHRUNG GEGENWERT (LION)	Währung Gegenwert	3-stellig alpha	muss	Eingabemöglichkeiten: EUR = EURO
ZIELREF	Zielkunden-	3/11-	keine	Bei der Auftragsart Depotübertrag -

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
	referenznummer	stellig 3/13-stellig		extern- in RS wird dieses Referenzfeld mit der CBF- und der Auftragsnummer systemseitig gefüllt.
ZU-GUNSTEN-KTO	zu-Gunsten-Konto	7-stellig	muss	Bei der Auftragsart Optionsscheintrennung können die notwendigen Zusatzbuchungen für die Optionsanleihen-ex und die nur-Options-scheine über ein abweichendes Depotkonto erfolgen.
ZU-LASTEN-KTO	zu-Lasten-Konto	7-stellig	muss	Bei der Auftragsart Optionsscheinzusammenführung können die notwendigen Zusatzbuchungen für die Optionsanleihen-ex und die nur-Optionsscheine über ein abweichendes Depotkonto des Auftraggebers erfolgen.

*** Muss- oder Kannfeld kann nicht eindeutig festgelegt werden, sondern hängt vom jeweiligen Vorgang ab

2.3.8 Spezifische Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

2.3.8.1 Die Zuordnungsnummern

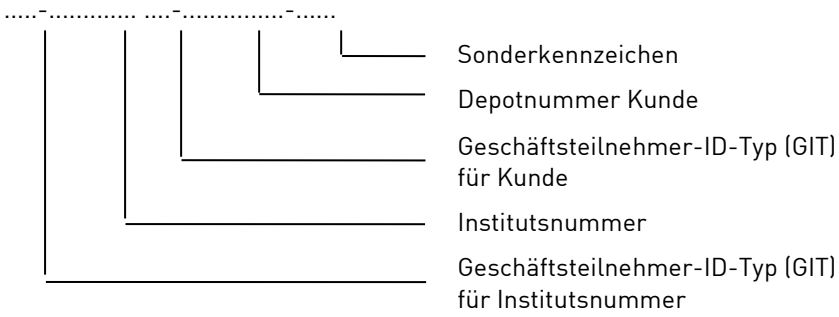
Die Stückenummern aus den eingelieferten Urkunden von Namensaktien (RS) werden mit der GS-Umstellung zu Zuordnungsnummern und im erweiterten Bestand zur jeweiligen Aktionärsnummer mitgeführt. Zu den Auftragsarten Depotübertrag, Bestandsübertrag und Emissionseinführung sind keine Zuordnungsnummern vom Kunden der CBF vorzugeben.

2.3.8.2 Die Kundenreferenz

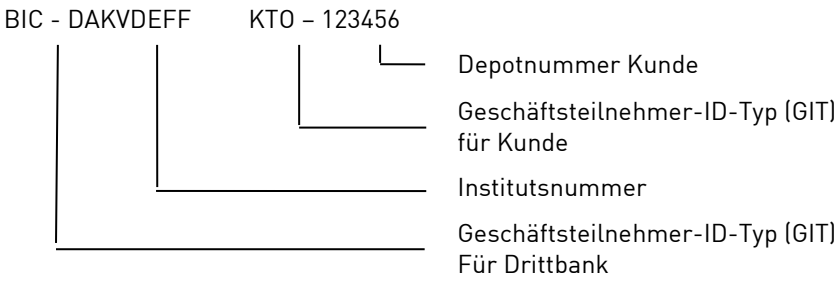
Die Kundenreferenz ermöglicht dem Eingeber je gewählter Auftragsart, Auftragsinformationen bezüglich des Auftraggebers bzw. Endbegünstigten zu spezifizieren. Sofern kein zweiter Kunde der CBF am Auftrag beteiligt ist, enthält die Kundenreferenz stets die Geschäftsteilnehmerdaten der eingebenden Seite. Zukünftig sollen damit sukzessive in allen betroffenen Auftragsarten die Felder Original-Auftraggeber und Endbegünstigter abgelöst werden.

Format und Inhalt der Kundenreferenz sind entsprechend standardisiert und werden, sofern allgemein gültig, in den nachfolgenden Abschnitten beschrieben. Auftragsspezifische Gegebenheiten sind in den entsprechenden Kapiteln dokumentiert.

Feldformate:



Beispiel:



Bestandteil Kundenreferenz	Bedeutung korrekt	Formal	Eingabe	Erklärung
Geschäftsteilnehmer-Identifikations-Typ (GIT)	Geschäftsteil-nehmer	3-stellig numerisch	***	Dieses Feld kann mit einem dreistelligen Kürzel belegt werden, welches die Angabe der Kundenreferenz Drittbank bzw. des Kunden im Hinblick auf eine maschinelle Weiterverarbeitung unterstützt. Folgende Inhalte werden derzeit bei der Eingabe formal geprüft: • BIC für Bank-Identifikations-Code • BLZ für Bankleitzahl • KTO für Konto • CED für CBL • EOC für Euroclear Wird die Kundenreferenz GIT Drittbank mit einem der aufgelisteten Kürzel belegt, muss eine Eingabe für die Kundenreferenz Drittbank erfolgen.
Institutsnummer (Drittbank)	Institutsnummer Drittbank	max. 11-stellig alphanum.	***	Konto/Filialnummer der Niederlassung des Kunden der CBF Die formale Eingabe der Drittbank richtet sich nach der gewählten GIT Ausprägung: *GIT Drittbank* BIC = durchgängig 8- oder 11-stellig BLZ 8-stellig KTO 13-stellig CED = 5-stellig (max.) EOC = 5-stellig (max.) SEC = 8-stellig (max.) Die Kundenreferenz Drittbank kann auch ohne Angabe einer GIT für die Drittbank angegeben werden.
Kunde	Kunde	max. 13-stellig alphanum.	***	Konto/Filialnummer der Niederlassung eines Teilnehmers der CBF bzw. Kontonummer des Kunden, der hinter dem Teilnehmer der CBF bzw. der Drittbank steht (Auftraggeber, Begünstigter). Die formale Eingabe des Kunden richtet sich nach der gewählten GIT Ausprägung: *GIT Drittbank* BIC = 8- oder 11-stellig BLZ8-stellig KTO 13-stellig CED 5-stellig (max.) EOC = 5-stellig (max.) SIS = 8-stellig (max.) Die Kundenreferenz Kunde kann auch ohne Angabe einer GIT für den Kunden

Bestandteil Kundenreferenz	Bedeutung korrekt	Formal	Eingabe	Erklärung
				eingegeben werden.
Sonderkenn-zeichen	Sonderkenn-zeichen	2-stellig numerisch	keine	Keine Belegung.

*** Muss- oder Kannfeld kann nicht eindeutig festgelegt werden, sondern hängt vom jeweiligen Vorgang ab.

2.4 Kontakte

Main business and administrative centre Frankfurt

Clearstream Banking Frankfurt

Mergenthalerallee 61
D-65760 Eschborn

www.clearstream.com
inquiries@clearstream.com

2.4.1 Ansprechpartner für CASCADE

2.4.1.1 Fachfragen

Clearstream Banking AG, Frankfurt

CSD Client Services Core Products and Connectivity

2.4.1.2 Fachfragen zu deutschen GS-Namensaktien (RS)

Clearstream Banking AG, Frankfurt

Registered Shares Team

2.4.1.3 Security-Angelegenheiten für die Online-Anwendungen

Deutsche Börse AG

Hauptsecurity-Beauftragter

3 Abwicklung Börsengeschäft (ohne CCP)

Die Abwicklung der Börsengeschäfte in Nicht-CCP-Instrumenten ist in das CASCADE-LION Online-System integriert.

Es werden aus folgenden Bereichen Geschäfte mit Abwicklungswährung Euro oder Fremdwährung eingestellt:

- Xetra-Handel (keine Geschäfte mit CCP-Abwicklung)
- Parkett-Handel (FWB keine Geschäfte mit CCP-Abwicklung)
- EEX-Stromhandel

Durch Eingabe des Funktionscodes „CA" im Einstiegsmenü der Gruppe Deutsche Börse „Funktionsangebot für den Bereich Clearstream Banking AG, Frankfurt Domestic" (siehe Band 1, Abschnitt 0) wird das Hauptauswahlmenü „CASCADE Auftragsabwicklung" aufgerufen:

```
TRAN: MENU FC:    SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          H A U P T A U S W A H L

       ERFASSUNGSSTATUS                     AUFTRAGSSTATUS

       EE   ERFASSUNG GIROBEREICH BANK      AM   MATCH-DIENST
       EW   ERFASSUNG WERTEBEREICH BANK     AS   SETTLEMENT-DIENST
       ED   ERFASSUNG CBF                   AI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK
       EA   AENDERUNG/LOESCHUNG GIROBER.    AA   AENDERUNG/LOESCHUNG
       EB   AENDERUNG/LOESCHUNG WERTEBER.   AR   RESERVIERUNGS-DIENST
       EI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK        AC   SELBSTBESICHERUNG
       EK   KONTROLLE GIROBEREICH           AN   NOTFALL-DIENST
       EC   KONTROLLE WERTEBEREICH

       BOERSENGESCHAEFTSABWICKLUNG          NACHRICHTENABWICKLUNG

       LS   SETTLEMENT BEARBEITUNG          NI   INFORMATION
       LA   AENDERUNG/LOESCHUNG
       LI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK

-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79303FX -- 19/11/14 -- 11:00:26 --

KV0005I Funktion beendet, bitte wählen Sie aus
```

Folgende Funktionen sind möglich:

Funktionscode	Funktion	Experteneinstieg
LS	Settlement-Dienst	KVLS
LA	Änderung/Löschung	KVLA
LI	Information/Online-Druck	KVLI

3.1 Auftragserteilung

Börsengeschäfte in Nicht-CCP-Gattungen werden nach Handelsschluss aus XONTRO-Trade an CBF übergeleitet und als Lieferinstruktion gemäß von dem Kunden gewählten Freigabeverfahren (gesperrt oder freigegeben) in LION eingestellt.

Die Erfüllungsfrist beträgt in der Regel zwei Tage (T+2).

Für die weitere Auftragsabwicklung ist entscheidend, an welchem Lieferfreigabeverfahren der Kunde teilnimmt. Der Kunde kann zwischen zwei Verfahren wählen:

Beim Positiv-Verfahren werden alle Verkauf-Lieferinstruktionen zunächst mit einer Settlement-Sperre in CASCADE-LION eingestellt und sind dann vom Kunden freizugeben. Eine Teilbelieferung gesperrter Geschäfte ist möglich. Die Freigabe einer Verkauf-Lieferinstruktion muss vor Beginn des Settlementlaufs erfolgen.

Beim Negativ-Verfahren werden alle Verkauf-Lieferinstruktionen sofort zur Belieferung freigegeben, können aber vom Kunden noch bis vor Beginn des nächsten Settlementzyklus gesperrt werden.

Börsengeschäfte mit identischem Last- und Gutschriftkonto in CASCADE-LION (s. g. Kompensationsgeschäfte) werden abhängig vom gewählten Lieferfreigabeverfahren mit (Positiv-Verfahren) oder ohne (Negativ-Verfahren) Settlement-Sperre in den Lieferbestand eingestellt.

3.2 Auftragsbearbeitung – Settlement (LS)

3.2.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Im Settlement-Dienst werden die Börsengeschäfte bearbeitet. Dazu werden die Lieferpositionen für die nächste CASCADE-Disposition, freigegeben oder zurückgestellt.

- Drei Funktionen unterstützen den Settlement-Dienst:
- Freigabe und Sperren des Börsengeschäftes für die Belieferung in der entsprechenden Disposition durch die Funktion „Settlement-Dienst Bearbeitung“
- Gesamt-Rückstellung aller Börsengeschäfte eines Lieferbestandes für die nächste Disposition durch die Funktion „Gesamt-Rückstellung“
- Rücknahme einer Gesamt-Rückstellung durch die Funktion „Rücknahme Gesamt-Rückstellung"

Ausgehend vom Hauptauswahlmenü „Auftragsabwicklung" erfolgt der Einstieg durch die Eingabe des Funktionscodes „LS" in die Auswahlmaske „Settlement-Dienst Börsengeschäfte". Der sog. Experteneinstieg ist aus jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode „KVLS" möglich:

```
TRAN: KVLS FC:    SB: V###########

BOERSENGESCHAEFTE         S E T T L E M E N T - D I E N S T

    SB  SETTLEMENT-DIENST BEARBEITUNG      GR  GESAMT-RUECKSTELLUNG
                                           RG  RUECKNAHME GESAMT-RUECKSTELLUNG

          KENNZEICHEN KAUF/VERKAUF (K/V) : V
          VERWAHRART                     : ...


                              ZUSATZAUSWAHL

          BANKNUMMER                     : ....
          WKN VON                        : . ............
          SETTLEMENT-SPERRE (S,F,A)      : .
          WAEHRUNG GEGENWERT             : ...
          SCHLUSSTAG                     : ..........
          EINGEBER/GESCHAEFTSNUMMER      : .... .......


-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 08:08:08 --

PF3: Rücksprung  PF4: Abbruch
```

Mögliche Funktionen:

Die Funktionscodes in Verbindung mit den Feldeingaben und deren Kombination sind im Settlement-Dienst wie nachfolgend aufgeführt anwendbar:

Funktionscode	Funktion	Eingaben
SB	Bearbeitung von Börsengeschäften zur Freigabe/Sperre oder Gesamt-Rückstellung	*Vorbelegt* [1]: • „V" für Kennzeichen Verkauf [2] • „GS" für Verwahrart • „EUR" für Währung • Settlement-Sperre • „A" für keine Einschränkung Auswahl *mehrerer* Börsengeschäfte: *Optional:* • Banknummer3] Bearbeitet eine Zentrale mit der REG-Überbeziehung mehr als 16 Filialen, so ist die Banknummer Mussfeld. • „STR", „WPR" oder „AKV" für die Verwahrart • Währung 3-stelliger Währungsschlüssel "EUR" für die Bearbeitung von EUR-Geschäften für weitere mögliche Fremdwährungen siehe Band 2 Kapitel 7.6.2. • WKN von • Settlement-Sperre „S" für gesperrt „F" für freigegeben
SB		Auswahl eines Börsengeschäftes *Optional:* • Banknummer [3] Bearbeitet eine Zentrale mit der REG-Überbeziehung mehr als 16 Filialen, so ist die Banknummer Mussfeld. *Eingabepflichtig* [6]: • WKN von • Schlusstag • Eingeber • Geschäftsnummer
GR	Gesamt-Rückstellung aller Börsengeschäfte für eine oder mehrere Dispositionen [8]	*Vorbelegt* [1]: • „V" für Kennzeichen Verkauf [2] *Optional:* • Banknummer [7] Bearbeitet eine Zentrale mit der REG-Überbeziehung mehr als 16 Filialen, so ist die Banknummer Mussfeld.
RG	Rücknahme einer Gesamt-Rückstellung aller	*Vorbelegt* [1]:

Funktionscode	Funktion	Eingaben
	Börsengeschäfte für eine oder mehrere Dispositionen 8)	• „V" für Kennzeichen Verkauf 2) *Optional:* • Banknummer 7) Bearbeitet eine Zentrale mit der REG-Überbeziehung mehr als 16 Filialen, so ist die Banknummer Mussfeld.

3.2.1.2 Fußnotenverzeichnis:

Die Vorbelegung erfolgt, wenn folgende Felder nicht gefüllt sind:

- Schlusstag
- Eingeber und
- Geschäfts-Nummer

Im Settlement-Dienst sind nur die Geschäfte auf der „Verkäuferseite" des Kreditinstitutes bearbeitbar.

Wird die Banknummer aus der User-ID ermittelt, dann werden bei Banken mit Reg.-Über-Verfahren der Zentrale eigene Geschäfte und jene der zugeordneten Niederlassungen (nur bis zu 16 Filialen möglich) zur Information und Bearbeitung angezeigt. Die Niederlassung kann nur eigene Geschäfte betrachten bzw. bearbeiten. Sind mehr als 16 Filialen mit einer Zentrale verbunden, kann die Zentrale nur mit der zusätzlichen Eingabe der Filial Banknummer deren Geschäfte zur Bearbeitung bzw. Information aufrufen.

Die eingabepflichtigen Felder müssen in Kombination eingegeben werden.

Erfolgt bei einer Zentrale keine explizite Eingabe einer Banknummer, so werden alle Geschäfte der Zentrale und jene der zugeordneten Niederlassung zurückgestellt. Erfolgt die Eingabe einer Banknummer so werden nur die Geschäfte der angegebenen Bank zurückgestellt. Das Gleiche gilt für die Rücknahme einer Rückstellung.

3.2.2 Settlement-Sperre und –Freigabe (SB)

3.2.2.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Im „Settlement-Dienst Bearbeitung" können die Lieferpositionen unter der Funktion „SB" freigegeben oder gesperrt werden. Zusätzlich können Teilbelieferungen gesperrter Geschäfte erfolgen.

Dabei kann die Zentrale eines Kreditinstitutes sowohl ihre eigenen als auch die Geschäfte der Niederlassung(en) bearbeiten. Die Niederlassung(en) kann/können ihre eigenen Geschäfte bearbeiten.

Beim Einstellen der Lieferpositionen wird das Feld „Settlement-Status" entsprechend dem von dem Kreditinstitut gewählten Freigabe-Verfahren vorbelegt. Das gewählte Verfahren gilt sowohl für die Zentrale als auch die Niederlassung(en):

Positiv-Teilnehmer	Negativ-Teilnehmer
Alle Positionen erhalten den Settlement-Status „gesperrt durch den Verkäufer": Vorbelegung des Feldes Settlement-Status erfolgt mit „S".	Alle Positionen erhalten den Settlement-Status: „zur Disposition freigegeben": Vorbelegung des Feldes Settlement-Status erfolgt mit „F".

Ausnahme:

Geschäfte mit der Verwahrart STR und WPR d. h. ein Kontrahent unterhält kein Auslandskonto bei CBF. Diese werden als gesperrt, also dem Positiv-Verfahren entsprechend, eingestellt.

Hinweis:

Über die Zusatzauswahl in der Auswahlmaske „Settlement-Dienst" kann durch das Feld „Settlement-Sperre" eingegrenzt werden, ob die gesperrten (S), nur die freigegebenen (F) oder alle bearbeitbaren Lieferpositionen (A) angezeigt werden sollen. Wird eine Einschränkung mit „S" oder „F" vorgenommen, entfällt in der Anzeige der Börsengeschäfte die Vorbelegung des Feldes „Settlement-Status".

Die Sperre/Freigabe gilt solange, bis das Börsengeschäft freigegeben bzw. gesperrt wird.

Eine Settlement-Sperre kann durch Eingabe einer Settlement-Freigabe und umgekehrt eine Freigabe durch Eingabe einer Sperre zurückgenommen werden.

Zusatzrechte aus Depotverwaltungsvorgängen können prinzipiell unabhängig vom Hauptgeschäft bearbeitet werden. Lediglich wenn das Hauptgeschäft an dem Tag freigegeben wird, an dem das Zusatzrecht eingerichtet wird, erfolgt die Freigabe des Zusatzrechtes automatisch mit der Freigabe des Hauptgeschäftes. Das Zusatzrecht wird unter der Wertpapier-Kennnummer des Zusatzrechtes mit der Börsengeschäftsnummer des Hauptgeschäftes angezeigt.

3.2.2.2 Teilbelieferungen

Im Settlement-Dienst ist eine Teilbelieferung gesperrter Börsengeschäfte nach der Eingabe eines „T" in der tabellarischen Kurzanzeige möglich. Es wird dann in die Maske zur Eingabe der Teilnominale verzweigt. Werden mehrere Geschäfte mit einem „T" gekennzeichnet, so erscheinen die Positionen zur Eingabe der Teilnominale in der Reihenfolge der gesetzten Kennzeichen

Der Einstieg erfolgt vom Hauptauswahlmenü durch die Eingabe des Funktionscodes „LS" in die Auswahlmaske „Settlement-Dienst" und von dort durch Wahl des Funktionscodes „SB" zur Maske „Settlement-Dienst Bearbeitung". Der sog. Experteneinstieg ist aus jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode KVLS sowie den Funktionscode „SB" möglich.

Nach dem Betätigen der Datenfreigabe-Taste wird die Maske zur Verfügung gestellt:

3.2.2.2.1 (B) Tabellarische Anzeige Börsengeschäfte

```
TRAN: KVLS FC: SB SB: V#GS#7930###A#EUR####

BOERSENGESCHAEFTE      S E T T L E M E N T - D I E N S T         SEITE     1

BESTAND VOM  19.11.2014   VERKAUF   GS                          KONTO: 7930

KZ V S WKN            GESNR SLTAG       NOMINALE       AUSM.BETRAG GKTO BEMERKUNG
S  0 1 DE0002574203 5600002 17.11*          60.000         60.881,67 6789 AS XE
S  0 1 DE0009404011 5600003 17.11*             100             37,15 5678









-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 10:54:43 --

PF1:Hilfe  PF2:Druck  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I" = Vollanzeige eines Börsengeschäftes.

„X" = Settlement-Freigabe oder -Sperre des Börsengeschäftes

„T" = Verzweigung in die Maske zur Teilbelieferung bei gesperrten Geschäften).

„D" = Druck aller Daten des selektierten Auftrages nach Betätigung der Taste PF2

„X" und „I" = können nicht miteinander kombiniert werden.

„T" und „I" = können nicht miteinander kombiniert werden.

„D" und „X" = können nicht miteinander kombiniert werden.

„D" und „I" = können nicht miteinander kombiniert werden.

„T" und „X" = können beliebig kombiniert werden.

Die Lieferpositionen erscheinen als tabellarische Kurzanzeige. Durch die Eingabe des Kennzeichens „I" vor einer Lieferposition ist die Vollanzeige dieses Geschäftes zur Information möglich. Die Sperre/Freigabe erfolgt jedoch nur in der Kurzanzeige.

Alle den Auswahlkriterien entsprechenden Börsengeschäfte werden in Kurzform angezeigt. Das in der Kopfzeile angegebene Datum für den „Bestand" und das Last-/Gut-Konto gelten für alle angezeigten Aufträge. Die Erläuterungen der verwendeten Abkürzungen im Feld "Bemerkung" werden durch die Aktivierung der Hilfemaske über die Taste PF1 aufgerufen. Zusätzlich zu den buchungsrelevanten Feldern wird auch der Settlement-Status (Kopfzeile = „S") des jeweiligen Geschäftes angezeigt, sofern der Settlement-Status nicht selektiert wird:

Status 0 = Auftrag zur Disposition freigegeben

Status 1 = Auftrag gesperrt durch den Auftraggeber

Status 2 = Auftrag gesperrt durch den Empfänger

Status 3 = Auftrag gesperrt durch Auftraggeber und Empfänger

Durch die Settlement-Sperre bzw. Freigabe wird der Settlement-Status entsprechend verändert.

In dem aufgelisteten Lieferbestand können sich auch Restanten älteren Datums befinden.

Der „Stern" (= *) hinter dem Datum des Schlusstages kennzeichnet ein Tagesgeschäft.

3.2.2.2.2 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Während die Kennzeichen „X", „T" und „D" in der tabellarischen Kurzanzeige gleichzeitig für mehrere Börsengeschäfte gesetzt werden können, ist nur ein "I" auf einer Maskenseite erlaubt, um in eine Vollanzeige zu verzweigen.

Unter nachfolgenden Bedingungen werden im „Settlement-Dienst Bearbeitung" Lieferpositionen *nicht* angezeigt:

- Die Position ist storniert,
- Es handelt sich um eine Aufgabe oder Aufgabe Weitergabe,
- Es handelt sich um eine Kompensation,
- Die Position ist durch den Käufer zur Löschung gekennzeichnet,
- Die Position ist durch den Verkäufer zur Löschung gekennzeichnet,
- Die Position ist durch beide Kontrahenten zur Löschung gekennzeichnet,
- Die Position wurde durch beide Kontrahenten am Vortag gelöscht
- Es handelt sich um eine reservierte Position mit Gegenwert in Fremdwährung.

3.2.2.2.3 (D) Vollanzeige von Börsengeschäften

Wird vor einem Börsengeschäft das Feld „KZ" mit „I" überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller Informationen der Schlussnote, gegebenenfalls über mehrere Masken.

3.2.3 Gesamt-Rückstellung (GR)

3.2.3.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Wenn ein Kreditinstitut an einem Tag alle Verkäufe des Lieferbestandes von der Belieferung für eine Disposition zurückstellen will, kann es dies über eine separate Funktion „Gesamt-Rückstellung" innerhalb des Settlement-Dienstes erreichen.

Über die Funktion „Rücknahme Gesamt-Rückstellung" (RG) kann eine Gesamt-Rückstellung jedoch wieder zurückgenommen werden (siehe nachfolgenden Abschnitt).

Die Gesamt-Rückstellung der Lieferpositionen kann auch von einer Zentrale für ihre Niederlassung vorgenommen werden. Eine gesetzte Gesamt-Rückstellung wird nach einer Disposition automatisch zurückgesetzt, sofern diese Rückstellung nicht für mehrere Dispositionen vorgenommen wurde.

Ausgehend vom Hauptauswahlmenü erfolgt der Einstieg durch die Eingabe des Funktionscodes „LS" (Settlement-Dienst) in die Auswahlmaske „Settlement-Dienst" und von dort durch Wahl des Funktionscodes „GR" zur Maske „Gesamt-Rückstellung". Der sog. Experteneinstieg ist aus jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode KVLS sowie den Funktionscode „GR" möglich.

Nach dem Betätigen der Datenfreigabe-Taste wird die folgende Auswahlmaske zur Verfügung gestellt:

3.2.3.1.2 (B) Auswahlmaske Gesamt-Rückstellung

```
TRAN: KVLS FC: GR SB: V##7930########

BOERSENGESCHAEFTE         G E S A M T - R U E C K S T E L L U N G

BESTAND VOM  19.11.2014                                    KONTO   7930

                 DIESE FUNKTION STELLT ALLE BOERSENGESCHAEFTE

                              DER BANK  7930

                     FUER FOLGENDE DISPOSITIONSARTEN

                     1.SDS (1)        2.SDS/STD       (4)
                     2.SDS (2)        1.SDS/2.SDS/STD (5)
                     STD   (3)

                      VON DER VERARBEITUNG ZURUECK

                  DISPOSITIONS-ART (1/2/3/4/5): 2 2.SDS


-- ID-KZ: 7930220003 -- PW:          ------ B7930743G -- 19/11/14 -- 11:46:34 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (Dispositions-Arten):

1 = Rückstellung aller Verkäufe des Lieferbestandes für die 1.SDS Batchverarbeitung (Massendisposition)

2 = Rückstellung aller Verkäufe des Lieferbestandes für die 2.SDS Batchverarbeitung (Massendisposition)

3 = Rückstellung aller Verkäufe des Lieferbestandes für die abendliche Batchverarbeitung (STD)

4 = Rückstellung aller Verkäufe des Lieferbestandes für die 2. SDS Batchverarbeitung (Massendisposition) und die abendliche Batchverarbeitung (STD)

5 = Rückstellung aller Verkäufe des Lieferbestandes sowohl für die 1. und 2. SDS Batchverarbeitung (Massendisposition) als auch die abendliche Batchverarbeitung (STD)

3.2.3.1.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es kann nur eine der fünf Dispositions-Arten angegeben werden. Die Dispositions-Art „3“ kann während der gesamten Online-Zeit des Systems eingegeben werden. Die anderen Dispositions-Arten können nur bis zum Beginn der jeweiligen SDS-Buchung gesetzt werden.

3.2.4 Rücknahme Gesamt-Rückstellung (RG)

3.2.4.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Kreditinstitute, die das Reg.-Über-Verfahren nutzen, können über die Zentrale auch eine Rücknahme der Gesamt-Rückstellung für ihre Niederlassungen vornehmen. Dies ist unabhängig davon, ob die vorher getätigte Gesamt-Rückstellung durch die Zentrale oder die Niederlassung durchgeführt wurde. Die Clearstream Banking AG, Frankfurt, kann alle Gesamt-Rückstellungen - unabhängig davon, wer sie eingegeben hat -zurücknehmen.

Eine Gesamt-Rückstellung wird nach der letzten Buchung, für welche diese Rückstellung gesetzt wurde, automatisch aufgehoben.

Der Einstieg erfolgt ausgehend vom Hauptauswahlmenü durch die Eingabe des Funktionscodes „LS" (Settlement-Dienst) in die Auswahlmaske „Settlement-Dienst" und von dort durch Wahl des Funktionscodes „RG" zur Maske "Rücknahme Gesamt-Rückstellung". Der sog. Experteneinstieg ist aus jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode KVLS sowie den Funktionscode „RG" möglich.

Nach dem Betätigen der Datenfreigabe-Taste wird die folgende Auswahlmaske zur Verfügung gestellt:

3.2.4.1.2 (B) Auswahlmaske Rücknahme Gesamt-Rückstellung

```
TRAN: KVLS FC: RG SB: V###########

BOERSENGESCHAEFTE          R U E C K N A H M E GESAMT-RUECKSTELLUNG

BESTAND VOM  19.11.2014                                      KONTO  7930



                  DIESE FUNKTION NIMMT EINE ZUVOR EINGEGEBENE

                GESAMT-RUECKSTELLUNG FUER DIE SDS-DISPOSITION

                                DER BANK 7930

                                   ZURUECK


                                KENNZEICHEN (J): J



-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 12:08:08 --

PF3: Verarbeitung  PF4: Abbruch
```

Eingebbares Kennzeichen (KZ):

„J" = Ja

Mit diesem Kennzeichen wird die Gesamt-Rückstellung, die der eingebende Kunde bereits durchgeführt hat, aufgehoben. Änderung/Löschung „Börsengeschäfte" (LA)

Mit dem Dienst „Änderung/Löschung Börsengeschäfte" ist es möglich

- Teilbelieferungen vorzunehmen
- Lieferpositionen zur Löschung zu kennzeichnen
- Die Dispositionsprioritäten für ein Börsengeschäft festzulegen

3.3 Auftragsbearbeitung – Änderung und Löschung (LA)

3.3.1.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Ausgehend vom Hauptauswahlmenü „Auftragsabwicklung" erfolgt der Einstieg durch die Eingabe des Funktionscodes „LA" in die Auswahlmaske „Änderung/Löschung Börsengeschäfte". Der sog. Experteneinstieg ist aus jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode „KVLA" möglich:

```
TRAN: KVLA FC:    SB:

BOERSENGESCHAEFTE          A E N D E R U N G / L O E S C H U N G

    AL  AENDERUNG LIEFERPOSITION          LL  LOESCHUNG LIEFERPOSITION
                                          RL  RUECKNAHME LOESCHUNG

         KENNZEICHEN KAUF/VERKAUF (K/V) : V
         VERWAHRART                     : ...


                            ZUSATZAUSWAHL

         BANKNUMMER                     : ....
         WKN VON                        : . ............
         SETTLEMENT-SPERRE (S,F,A)      : .
         WAEHRUNG GEGENWERT             : ...
         SCHLUSSTAG                     : ..........
         EINGEBER/GESCHAEFTSNUMMER      : .... .......


-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 11:00:52 --

SY0043A BITTE DATEN EINGEBEN
```

Die verschiedenen Einstiege sowie Feldkombinationen im Auswahlmenü „Änderung/Löschung Börsengeschäfte" erläutert nachfolgende Tabelle:

Mögliche Funktionen:

Funktionscode	Funktion	Eingaben
AL	Durchführung von Teil-belieferungen bei bereits in den Lieferbestand eingestellten Börsen-Geschäften. Festlegung von Dispositionsprioritäten (gilt nur für WKN mit Verwahrart „GS").	*Vorbelegt* [1]: • „V" für Kennzeichen Verkauf [2] • „GS" für Verwahrart • „EUR" für Währung • Settlement-Sperre • „A" für keine Einschränkung Auswahl *mehrerer* Börsengeschäfte: *Optional:* • Banknummer [3] • „STR", „WPR" oder „AKV" für die Verwahrart • Währung • 3-stelliger Währungsschlüssel "EUR" für die Bearbeitung von EUR-Geschäften für weitere mögliche Fremdwährungen siehe Band 2 Kapitel 7.6.2.

Funktionscode	Funktion	Eingaben
		• WKN von • Settlement-Sperre • „S" für gesperrt „F" für freigegeben
AL		Auswahl *eines* Börsengeschäftes: *Optional:* • Banknummer [3)] *Eingabepflichtig* [6)]: • WKN von • Schlusstag • Eingeber • Geschäftsnummer
LL	Bereits in den Lieferbestand eingestellte Börsengeschäfte werden zur Löschung gekennzeichnet (gilt nur für WKN mit Verwahrart "GS")	*Vorbelegt* [1)]: • „V" für Kennzeichen Verkauf • „GS" für Verwahrart • „EUR" für Währung • Settlement-Sperre • „A" für keine Einschränkung Auswahl *mehrerer* Börsengeschäfte: *Optional:* • „K" bei Kennzeichen Kauf • Banknummer [3)] • „STR", "WPR" oder "AKV" für die Verwahrart • Währung 3-stelliger Währungsschlüssel „EUR" für die Bearbeitung von EUR-Geschäften; weitere mögliche Fremdwährungen siehe Band 2 Kapitel 7.6.2.
LL		• WKN von • Settlement-Sperre „S" für gesperrt „F" für freigegeben Auswahl *eines* Börsengeschäftes: *Optional*: • Banknummer [3)] *Eingabepflichtig* [6)]: • WKN von • Schlusstag • Eingeber • Geschäftsnummer
RL	Rücknahme eines eigenen Lösch-Kennzeichens für Börsengeschäfte	*Vorbelegt* [1)]: • „V" für Kennzeichen Verkauf • „GS" für Verwahrart

Funktionscode	Funktion	Eingaben
		• „EUR" für Währung • Settlement-Sperre • „A" für keine Einschränkung
RL		Auswahl *mehrerer* Börsengeschäfte: *Optional:* • „K" bei Kennzeichen Kauf • Banknummer [3] • „STR", „WPR" oder „AKV" für die Verwahrart • Währung 3-stelliger Währungsschlüssel „EUR" für die Bearbeitung von EUR-Geschäften; weitere mögliche Fremdwährungen siehe Band 2 Kapitel 7.6.2. • WKN von • Settlement-Sperre „S" für gesperrt „F" für freigegeben Auswahl *eines* Börsengeschäftes *Optional:* • Banknummer *Eingabepflichtig* [6]: • WKN von • Schlusstag • Eingeber • Geschäftsnummer

Fußnotenverzeichnis:

Die Vorbelegung erfolgt, wenn die Felder nicht gefüllt sind:

- „Schlusstag“,
- „Eingeber“ und
- „Geschäfts-Nummer“.

Der Änderungsdienst kann derzeit nur auf der Verkaufsseite genutzt werden (automatische Vorbelegung).

Wird die Banknummer aus der User-ID ermittelt, dann werden bei Banken mit Reg.-Über-Verfahren der Zentrale eigene Geschäfte und jene der zugeordneten Niederlassungen zur Information und Bearbeitung angezeigt. Die Niederlassung kann nur eigene Geschäfte betrachten bzw. bearbeiten.

Die eingabepflichtigen Felder müssen in Kombination eingegeben werden.

3.3.2 Änderung von Lieferpositionen (AL)

3.3.2.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Die Änderung bzw. Ergänzung von Börsengeschäften ist in der Funktion „Änderung Lieferposition“ (AL) nur durch den Verkäufer möglich.

Zu den Ergänzungen gehören derzeit:

- Benennung einer Teil-Nominale
- Änderung der Dispositionspriorität.

Je nach Ergänzungswunsch erfolgt die Selektion durch Eingabe des dafür vorgesehenen Kennzeichens vor der entsprechenden Lieferposition in der tabellarischen Kurzanzeige.

Der Einstieg erfolgt ausgehend vom Hauptauswahlmenü durch Eingabe des Funktionscodes „LA“ (Änderung/Löschung) in die Auswahlmaske „Änderung/Löschung“ und von dort durch Wahl des Funktionscodes „AL“ zur Maske „Änderung". Der sog. Experteneinstieg ist aus jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode KVLA sowie den Funktionscode „AL" möglich.

Nach dem Betätigen der Datenfreigabe-Taste wird die Maske zur Verfügung gestellt:

3.3.2.1.2 (B) Tabellarische Anzeige Änderung

```
TRAN: KVLA FC: AL SB: V#GS#7930###A#EUR####

BOERSENGESCHAEFTE      A E N D E R U N G                        SEITE     1

BESTAND VOM  19.11.2014   VERKAUF   GS                         KONTO: 7930

KZ V S WKN            GESNR SLTAG        NOMINALE    AUSM.BETRAG GKTO BEMERKUNG
_  0 1 DE0002574200 6600002 17.11*       60.000        60.881,67 6789
_  0 1 DE0008404012 6600003 17.11*          100            37,15 5678









-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 11:03:29 --

PF1:Hilfe  PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I"= Vollanzeige eines Börsengeschäftes

„X"= Vollanzeige des Börsengeschäftes für die Eingabe der Teilnominale

„D"= Druck aller Daten des selektierten Auftrages nach Betätigung der Taste PF2

3.3.2.1.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Die vier Kennzeichen können nicht miteinander kombiniert werden.

Während das Kennzeichen „D" gleichzeitig für mehrere Börsengeschäfte gesetzt werden kann, ist jeweils nur ein „I" oder „X" möglich.

Die Funktion „Änderung Lieferposition" kann nur von der Verkaufsseite genutzt werden.

Unter nachfolgenden Bedingungen werden in der „Änderung Lieferpositionen" Börsengeschäfte *nicht* angezeigt:

- Die Position ist storniert,
- Es handelt sich um eine Aufgabe oder eine Aufgabe-Weitergabe,
- Die Position ist vom Verkäufer und/oder Käufer zur Löschung gekennzeichnet,
- Es handelt sich um eine reservierte Position mit Gegenwert in Fremdwährung.
- Die Position wurde von beiden Kontrahenten am Vortag gelöscht.

Für die Kreditinstitute besteht die Möglichkeit, einen Teil der in einem Börsengeschäft angegebenen Gesamtnominale freizugeben und die Dispositionspriorität zu verändern.

Auch Kreditinstitute, die mit dem Negativ-Verfahren arbeiten, müssen Teilbelieferungen im Settlement-Dienst freigeben. Nach Eingabe eines „X" im Feld „KZ" verzweigt das System nach Datenfreigabe in die Vollanzeige des Börsengeschäftes zur Eingabe der Teilnominalen. Eine Rücknahme bzw. Änderung der Teilbelieferung kann bis zur nächsten Disposition vorgenommen werden.

3.3.2.1.4 (D) Vollanzeige von Börsengeschäften: Ergänzung „Teilnominale“

```
TRAN: KVLA FC: AL SB: V#GS####A#EUR####

BOERSENGESCHAEFTE          A E N D E R U N G

VERKAUF  GS          EINGEBER/GESNR: 7935 1315798  SLTAG: 19.11.2014   KONTO: 7930

WKN : DE0001051241 8 % BAYERN ANL. V. 84/94     STV 01.04. G


NOMINALE      : EUR           40.000         AUSM-BETRAG:  EUR   40.546,67
TEILNOMINALE  : EUR                          KURS       :            97,9000
URSPR.NOMINALE:                              KURSDIFF.  :

GEGEN-KONTO   : 7304  KREDITINSTITUT Y                EING-TAG:  17.11.2014
GEGENWERT-KZ  : 0 KEINE VALUTA                       VAL-TAG :
                                                     SET-DAY :  19.11.2014
       : 3 STD    DISPO-PRIORITAET : 4   MST    VERKETTUNG : N
SET-STATUS.   : 0 AUFTRAG ZUR DISPOSITION FREIGEGEBEN
DISPO-STATUS  : 1 STUECKE-DISPOSITION OFFEN
ORIG-XETRA-M. : 4321  EIGENG.: P     TEXT:  BOSS/


-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 08:08:08 --

PF2: Druck  PF3: Rücksprung  PF4: Abbruch  PF8: Vor
```

Eingebbare Daten:

„Teilnominale“ und „Dispo-Priorität“ in den jeweiligen gleichnamigen Feldern.

3.3.2.1.5 (E) Feldabhängigkeiten/Vollanzeige

Die Teilnominale kann nur durch den Verkäufer eingegeben werden.

Die Eingabe einer Teilnominalen ist nicht zulässig, wenn ein Stamm-Nummern-Geschäft vorliegt.

Die Nominale darf nicht „Null" (= 0) betragen.

Ist die Nominale gleich eins, dann ist keine Teilbelieferung mehr möglich.

Die Teilnominale muss kleiner als die (Gesamt-) Nominale sein.

3.3.2.1.6 (F) Vollanzeige von Börsengeschäften: Information

Wird vor einer Lieferposition das Feld KZ mit „I" überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Vollanzeige Seite eins bis drei zu Informationszwecken wie sie im "Informationsdienst Börsengeschäfte" (siehe Band 1, Abschnitt 3.4.2) erläutert wird. Die Vollanzeigen werden deshalb an dieser Stelle nicht beschrieben.

Eingabe von Dispositionsprioritäten

Mit der Eingabe selbst gewählter Dispositionsprioritäten je Geschäft können die Anwender die Reihenfolge der Verarbeitung der Geschäfte in der Stücke-Disposition beeinflussen. Die Dispositionsprioritäten lassen sich nur für GS-Geschäfte verändern. Bei anderen Verwahrarten ist keine Eingabe von Dispositionsprioritäten möglich.

3.3.2.1.7 (I) Eingabemaske der Dispositionsprioritäten

```
TRAN: KVLA FC: AL SB: V#GS####A#EUR####

BOERSENGESCHAEFTE          A E N D E R U N G

VERKAUF  GS     EINGEBER/GESNR: 7935 1325798  SLTAG: 25.10.2009   KONTO: 7930

WKN : DE0001051241 8 % BAYERN ANL. V. 84/94     STV 01.04. G


NOMINALE      : EUR           40.000         AUSM-BETRAG:  EUR   40.546,67
TEILNOMINALE  : EUR        _________         KURS        :            97,9000
URSPR.NOMINALE:                              KURSDIFF.   :

GEGEN-KONTO   : 7931  HANDELSBANK AG                    EING-TAG:  25.10.2009
GEGENWERT-KZ  : 0 KEINE VALUTA                          VAL-TAG :
                                                        SET-DAY :  28.10.2009
SET ART       :  STD       DISPO-PRIORITAET : _ ___      VERKETTUNG : N
SET-STATUS.   : 0 AUFTRAG ZUR DISPOSITION FREIGEGEBEN
DISPO-STATUS  : 1 STUECKE-DISPOSITION OFFEN
ORIG-XETRA-M. : 4321  EIGENG.:P     TEXT:


-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 28/10/09 -- 08:08:08 --

PF2: Druck  PF3: Rücksprung  PF4: Abbruch  PF8: Vor
```

Eingebbare Daten:

Die DISPO-PRIORITÄT (eine Beschreibung der Dispositionsprioritäten erfolgt in Band 1, Abschnitt 0).

„1“ = Batchverarbeitung (Massendisposition)
Priorität sehr hoch

„2“ = Batchverarbeitung (Massendisposition)
Priorität hoch

„3“ = Batchverarbeitung (Massendisposition)
Priorität mittel

„4“ = Batchverarbeitung (Massendisposition). Dies entspricht der Vorbelegung.
Priorität Standard

Löschung von Lieferpositionen (LL)

3.3.2.1.8 (A) Allgemeine Beschreibung

Wenn ein Geschäft von beiden Kontrahenten über die Funktion „Löschung einer Lieferposition" (LL) zur Löschung gekennzeichnet wurde, wird diese Löschung innerhalb der abendlichen Verarbeitung protokolliert. Das Geschäft wird noch einen Tag zur Information angezeigt und anschließend automatisch aus dem Lieferbestand gelöscht.

Geschäfte, die nur von einer Seite zur Löschung gekennzeichnet wurden, werden nicht disponiert. Sie werden vorgetragen, bis der Kontrahent sie ebenfalls zur Löschung kennzeichnet oder die Kennzeichnung zur Löschung zurückgenommen wird.

Lieferpositionen werden nur aus dem Lieferbestand gelöscht, wenn beide Kontrahenten die Löschung vorgenommen haben.

EEX-Stromhandelsgeschäfte können nur von der CBF auf Weisung der EEX gelöscht werden

Die Kennzeichnung zur Löschung erfolgt durch Eingabe des Kennzeichens „X“ in der tabellarischen Kurzanzeige.

Der Einstieg erfolgt ausgehend vom Hauptauswahlmenü durch die Eingabe des Funktionscodes "LA" in die Auswahlmaske "Löschung/Änderung" und von dort durch Wahl des Funktionscodes „LL" zur Maske "Löschung". Der sog. Experteneinstieg ist aus jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode KVLA sowie den Funktionscode „LL" möglich.

Nach dem Betätigen der Datenfreigabe-Taste wird die Maske zur Verfügung gestellt:

3.3.2.1.9 (B) Auswahlmaske Löschung

```
TRAN: KVLA FC: LL SB: V#GS#7930###A#EUR####

BOERSENGESCHAEFTE      L O E S C H U N G                        SEITE     1

BESTAND VOM  28.10.2009   VERKAUF   GS                          KONTO: 7930

KZ V S WKN            GESNR SLTAG        NOMINALE    AUSM.BETRAG GKTO BEMERKUNG
X  0 1 DE000357420  6600003 25.10*          60.000      60.881,67 6789
_  0 1 DE000840401  6600003 25.10*             100          37,15 5678









-- ID-KZ: 7930360009 -- PW:          ------ B793043G -- 28/10/09 -- 11:08:09 --
KV0023I Bitte mit PF3 bestätigen
PF1:Hilfe  PF2:Druck  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I" = Vollanzeige des Börsengeschäftes.

„X" = Mit diesem Kennzeichen wird das Börsengeschäft zur Löschung markiert.

„D" = Druck aller Daten des selektierten Auftrages nach Betätigung der Taste PF2

3.3.2.1.10 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Während die Kennzeichen „X" und „D" in der tabellarischen Kurzanzeige gleichzeitig für mehrere Börsengeschäfte gesetzt werden können, ist nur ein „I" auf einer Maskenseite erlaubt. Dies bedeutet, dass nicht gleichzeitig mehrere Börsengeschäfte zur Vollanzeige selektiert werden.

3.3.2.1.11 (D) Statusabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Unter nachfolgenden Bedingungen werden in der „Löschung Lieferpositionen" Börsengeschäfte *nicht* angezeigt:

- Die betreffende Position ist schon zur Disposition übergeleitet worden
- Das Geschäft ist storniert
- Es handelt sich um eine Aufgabe oder eine Aufgabe-Weitergabe
- Die Position wurde vom betreffenden Kreditinstitut schon zur Löschung gekennzeichnet
- Die Position ist durch beide Kontrahenten zur Löschung gekennzeichnet
- Die Position wurde durch beide Kontrahenten am Vortag gelöscht
- Es handelt sich um eine reservierte Position mit Gegenwert in Fremdwährung

3.3.3 Rücknahme Lösch-Kennzeichen (RL)

3.3.3.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Lösch-Kennzeichen können über eine separate Funktion „Rücknahme Löschung" (RL) durch Eingabe eines Kennzeichens in der tabellarischen Kurzanzeige zurückgenommen werden. Die Löschung kann nur bis zu nächsten Standard-Batchverarbeitung zurückgenommen werden.

Der Einstieg erfolgt ausgehend vom Hauptauswahlmenü durch die Eingabe des Funktionscodes „LA" in die Auswahlmaske „Änderung/Löschung" und von dort durch Wahl des Funktionscodes „RL" zur Maske „Rücknahme Löschung".

Nach dem Betätigen der Datenfreigabe-Taste wird die Maske mit den zur Löschung markierten Positionen zur Verfügung gestellt:

3.3.3.1.2 (B) Eingabemaske Rücknahme Löschung

```
TRAN: KVLA FC: RL SB: V#GS#7930###A#EUR####

BOERSENGESCHAEFTE      R U E C K N A H M E  L O E S C H U N G    SEITE     1

BESTAND VOM  28.10.2009   VERKAUF   GS                          KONTO: 7930

KZ V S WKN          GESNR   SLTAG      NOMINALE      AUSM.BETRAG GKTO BEMERKUNG
_  0 1 DE0002574201 6600002 25.10*       60.000      60.881,67   6789 LV









-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B793043G -- 28/10/09 -- 11:10:29 --

PF1:Hilfe  PF2:Druck  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I" = Vollanzeige des Geschäftes

„X" = Die Markierung zur Löschung eines Börsengeschäftes wird zurückgenommen.
(Die zwei Kennzeichen können nicht miteinander kombiniert werden.

3.3.3.1.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Während das Kennzeichen „X" in der tabellarischen Kurzanzeige gleichzeitig für mehrere Börsengeschäfte gesetzt werden kann, ist nur ein „I" auf einer Maskenseite erlaubt. Dies bedeutet, dass nicht gleichzeitig mehrere Börsengeschäfte zur Vollanzeige selektiert werden.

Unter nachfolgenden Bedingungen werden bei Aufruf der Funktion "Rücknahme Löschung" Lieferpositionen angezeigt:

- Es wurde ein eigenes Kennzeichen zur Löschung gesetzt,
- Die Position wurde von beiden Kontrahenten zur Löschung gekennzeichnet.

3.4 Informationen (LI)

3.4.1.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Der Informationsdienst kann vom Verkäufer und Käufer eines Börsengeschäftes genutzt werden.

Die Kreditinstitute erhalten über vier Funktionen die Möglichkeit, sich über ihre getätigten Börsengeschäfte, getrennt nach Verkauf/Kauf sowie Verwahrarten, zu informieren:

- über die gesamten eigenen Börsengeschäfte,
- über ihre Makler-Aufgaben,
- über die aus der Bearbeitung resultierenden Kontrollsummen,
- über die zugehörigen Abstimmsummen des Lieferbestandes.

Ausgehend vom Hauptauswahlmenü „Auftragsabwicklung" erfolgt der Einstieg durch die Eingabe des Funktionscodes „LI" in die Auswahlmaske „Informationsdienst Börsengeschäfte" oder auch von jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode „KVLI" (sog. Experteneinstieg).

```
TRAN: KVLI FC:    SB:

BOERSENGESCHAEFTE         I N F O R M A T I O N

    IB  INFORMATION LIEFERPOSITIONEN      IK  INFORMATION KONTROLLSUMMEN
    IA  INFORMATION AUFGABEN              IS  INFORMATION ABSTIMMSUMMEN

         KENNZEICHEN KAUF/VERKAUF (K/V) : .
         VERWAHRART                     : ...


                            ZUSATZAUSWAHL

         BANKNUMMER                     : ....
         WKN VON                        : . ............
         SETTLEMENT-SPERRE (S,F,A,L)    : .
         WAEHRUNG GEGENWERT             : ...
         SCHLUSSTAG                     : ..........
         EINGEBER/GESCHAEFTSNUMMER      : .... .......


-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B793043G -- 28/10/09 -- 11:13:03 --

SY0043A BITTE DATEN EINGEBEN
```

Die verschiedenen Funktionen sind mit Feldkombinationen zur Selektion im Informationsdienst wie folgt einzugrenzen:

Folgende Funktionen sind möglich:

Funktionscode	Funktion	Eingaben
IB	Anzeige des gesamten Lieferbestandes eines Kreditinstitutes	*Vorbelegt* [1]: • "V" für Kennzeichen Verkauf • "GS" für Verwahrart • Settlement-Sperre • "A" für keine Einschränkung • "EUR" für Währung Auswahl *mehrerer* Börsengeschäfte: *Optional:* • „K" für Kennzeichen Kauf • Banknummer [2] • „STR", „WPR" oder „AKV" für die Verwahrart • Währung 3-stelliger Währungsschlüssel „EUR" für die Bearbeitung von EUR-Geschäften; weitere mögliche Fremdwährungen siehe Band 2 Kapitel 7.6.2. • WKN von • Settlement-Sperre „S" für gesperrt „F" für freigegeben „L" für von mindestens einer Seite zur Löschung gekennzeichneter Aufträge
IB		Auswahl *eines* Börsengeschäftes: *Eingabepflichtig:* • „V" für Kennzeichen Verkauf Optional: • Banknummer [2] • *Eingabepflichtig:* [6] • WKN von • Schlusstag • Eingeber • Geschäftsnummer
IA	Anzeige des gesamten Aufgabenbestandes	*Vorbelegt* [1]: • „V" für Kennzeichen Verkauf • Auswahl *mehrerer* Aufgaben: • *Optional:* • „K" für Kennzeichen Kauf • Banknummer 6)] • WKN von

Funktionscode	Funktion	Eingaben
		• Auswahl *einer* Aufgabe: • *Optional:* • „K" für Kennzeichen Kauf • Banknummer [6] *Eingabepflichtig* [6]: • WKN von • Schlusstag • Eingeber • Geschäftsnummer
IK	Übersicht über die Aktivitäten und Ergebnisse im Lieferbestand für Freigaben und Rückstellungen	*Vorbelegt* [1]: • „V" für Kennzeichen Verkauf • „GS" für Verwahrart • „EUR" für Währung *Optional:* • „K" für Kennzeichen Kauf • Banknummer [6] • „STR", „WPR" oder „AKV" für die Verwahrart • Währung 3-stelliges Währungskürzel
IS	Übersicht über die Aktivitäten und Ergebnisse im Lieferbestand für Restanten und Tagesgeschäfte	*Vorbelegt* [1]: • „V" für Kennzeichen Verkauf • „GS" für Verwahrart • „EUR" für Währung Gegenwert *Optional:* • „K" für Kennzeichen Kauf • Banknummer [6] • „STR", „WPR" oder „AKV" für die Verwahrart • Währung 3-stelliger Währungsschlüssel „EUR" für die Bearbeitung von EUR-Geschäften; weitere mögliche Fremdwährungen siehe Band 2 Kapitel 7.6.2.

Fußnotenverzeichnis

1. Die Vorbelegung erfolgt, wenn die Felder
2. „Schlusstag", „Eingeber" und „Geschäfts-Nummer" nicht gefüllt sind.
3. Wird die Banknummer aus der User-ID ermittelt, dann werden bei Banken mit Reg.-Über-Verfahren der Zentrale eigene Geschäfte und jene der zugeordneten Niederlassungen zur Information und Bearbeitung angezeigt. Die Niederlassung kann nur eigene Geschäfte betrachten bzw. bearbeiten.
4. Hier ist bei der Auswahl eines Börsengeschäftes/einer Aufgabe nur „V" für Kennzeichen Verkauf möglich.
5. Wird die Banknummer aus der User-ID ermittelt, dann werden nur die Geschäfte der Kontonummer angezeigt, der die User-ID zugeordnet ist (entweder Zentrale oder Niederlassung).

6. Die eingabepflichtigen Felder müssen in Kombination eingegeben werden.

3.4.2 Lieferposition (IB)

3.4.2.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Funktion „Information Börsengeschäfte" (IB) ist die Anzeige des gesamten Lieferbestandes eines Kreditinstitutes möglich. Dabei können die angezeigten Geschäfte durch Eingabe von Selektionskriterien eingegrenzt werden.

Ausgehend vom Hauptauswahlmenü erfolgt der Einstieg durch Eingabe des Funktionscodes „LI" (Information/Online-Druck) in die Auswahlmaske „Information" und von dort durch Wahl des Funktionscodes „IB" zur Maske „Information Börsengeschäfte". Der sog. Experteneinstieg ist aus jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode KVLI sowie den Funktionscode „IB" möglich.

Nach dem Betätigen der Datenfreigabe-Taste wird die Maske zur Verfügung gestellt:

3.4.2.2 Tabellarische Anzeige

Auf der Maske der tabellarischen Kurzanzeige werden alle selektierten Börsengeschäfte mit den buchungsrelevanten Feldern aufgelistet. Zusätzlich werden Informationen bezüglich

- Verkettung (V) (derzeit nicht aktiv)
- Settlement-Status (S)

angezeigt. Settlement-Status „0" bedeutet ein freigegebenes Geschäft an, Settlement-Status "1" heißt ein vom Verkäufer gesperrtes Geschäft, Settlement-Status „3" steht für Aufgaben. Die Bemerkungen (z. B. „AS" für Aufgabenschließung) geben nähere Hinweise zu dem Börsengeschäft. Die Erläuterung und Bedeutung der Bemerkungen können mit Hilfe der Taste PF1 aufgerufen werden. Darüber hinaus sind sie im Band 2, Abschnitt 7.2 beschrieben.

3.4.2.2.1 (B) Tabellarische Auswahl/Information

```
TRAN: KVLI FC: IB SB: V#GS#7930###A#EUR####

BOERSENGESCHAEFTE      I N F O R M A T I O N                    SEITE     1

BESTAND VOM  28.10.2009   VERKAUF   GS                          KONTO: 7930

KZ S WKN            GESNR SLTAG        NOMINALE      AUSM.BETRAG GKTO BEMERKUNG
   1 DE0002574201 6600002 25.10*          60.000        60.881,67 6789
_  1 DE0008404011 6600003 25.10*             100            37,15 5678









-- ID-KZ: 79307260009 -- PW:          ------ B793043G -- 28/10/09 -- 11:17:36 --

PF1:Hilfe  PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I" = Selektion des Börsengeschäftes zur Vollanzeige

„D" = Druck aller Daten des selektierten Auftrages nach Betätigung der Taste PF2

3.4.2.2.2 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

In der tabellarischen Kurzanzeige ist nur ein „I" auf einer Maskenseite erlaubt. Dies bedeutet, dass nicht gleichzeitig mehrere Lieferpositionen zur Vollanzeige selektiert werden können.

Die Markierung mehrerer Aufträge mit dem Kennzeichen „D" ist zulässig. Demgegenüber ist eine Kombination zwischen „I" und „D" *nicht* möglich.

3.4.2.3 Vollanzeige

Wird vor einem Börsengeschäft das Feld KZ mit „I" überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller Felder, ggf. über mehrere Masken:

3.4.2.3.1 (D) Vollanzeige von Börsengeschäften

```
TRAN: KVLI FC: IB SB: V#GS#7930###A#EUR####

BOERSENGESCHAEFTE        INFORMATION

VERKAUF  GS         EINGEBER/GESNR: 7930 6600002 SLTAG: 25.10.2009 KONTO: 7930

WKN: DE0002574201  3,5 % HYP.BK.ESSEN OPF.E.520 05.11.G


NOMINALE      : EO           60.000       AUSM-BETRAG: EUR         60.881,67
TEILNOMINALE  :                           KURS       :               100,4000
URSPR-NOMINALE:                           KURSDIFF   :

GEGEN-KONTO   : 7931 HANDELSBANK AG                      EING-TAG: 25.10.2009
GEGENWERT-KZ  : 0 KEINE FESTVALUTA                       VAL-TAG :
                                                         SET-DAY : 28.10.2009
SET ART      : STD           DISPO-PRIORITAET: 4 MST      VERKETTUNG: N
SET-STATUS    : 1 AUFTRAG GESPERRT DURCH DEN AUFTRAGGEBER
DISPO-STATUS  : 1 STUECKE-DISPOSITION OFFEN
ORIG-XETRA-M. :       EIGENG.:       TEXT:

-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B793043G -- 28/10/09 -- 11:19:09 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Aus der Vollanzeige kann mittels der Taste PF2 ein Online-Druck des angezeigten Geschäftes erfolgen. Wenn sich die Vollanzeige über mehrere Masken erstreckt, werden alle Maskeninhalte ausgedruckt, unabhängig davon, in welcher Maske der Online-Druck initiiert wurde.

In der Vollanzeige-Maske 3 kann durch PF1 die Hilfemaske für die Kürzel unter „Bemerkungen" aufgerufen werden.

Durch Betätigen der PF8-Taste ist ein Blättern in die Vollanzeige-Maske 2 möglich, die PF7-Taste ermöglicht das Zurückblättern:

```
TRAN: KVLI FC: IB SB: V#GS#7930###A#EUR####

BOERSENGESCHAEFTE        INFORMATION

VERKAUF  GS         EINGEBER/GESNR: 7930 6600002 SLTAG: 26.10.2009 KONTO: 7930



      BONI-SATZ    :                    BONI-BETRAG    :

      COURTAGE-SCHL:                    COURTAGE-BETRAG:

                                        SPESEN-BETRAG  :

      PROV-SATZ    :                    PROV-BETRAG    :

      DEVISENKURS  :                    KOPF-KURS      :         100,4000



-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B793043G -- 28/10/09 -- 11:20:41 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

Durch erneutes Betätigen der PF8-Taste wird die Vollanzeige-Maske 3 aufgerufen:

```
TRAN: KVLI FC: IB SB: V#AKV#9999##FR00334375#A#EUR####

BOERSENGESCHAEFTE        INFORMATION

VERKAUF  GS         EINGEBER/GESNR: 7930 6600002 SLTAG: 26.10.2009 KONTO: 7930

    URSPR-DATUM :                       URSPR-NR  :

                                        ZINSTAGE  :
    ABW-ZINSLAUF:                       ZINSBETRAG:



    BEMERKUNGEN : ZR

CORPORATE ACTIONS
TA  BID          CAEV TEXT                                    CA-WKN



-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B79075R5 -- 07/07/09 -- 13:27:28 --

PF1:Hilfe  PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

Hinweis: Im Feld „Corporate Actions“ wird/werden die Terminart(en) aufgeführt (siehe auch Band 2, Anhang).

3.4.3 Aufgaben (IA)

3.4.3.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Zusätzlich zur Funktion „Information Börsengeschäfte", in der auch die Tagesaufgaben enthalten sind, wird in der Funktion "Information Aufgaben" (IA) der gesamte Aufgabenbestand zur Information in tabellarischer Kurzanzeige angezeigt. Die Anzeige der Aufgaben kann nach Kauf- und Verkaufsseite selektiert werden, eine Bearbeitung der Aufgaben ist nicht möglich.

Ausgehend vom Hauptauswahlmenü gelangt der Anwender durch Eingabe des Funktionscodes „LI" (Information/Online-Druck) in die Auswahlmaske „Information" und von dort durch Wahl des Funktionscodes „IA" zur Maske "Information Aufgaben". Der sog. Experteneinstieg ist aus jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode KVLI sowie den Funktionscode „IA" möglich.

Nach dem Betätigen der Datenfreigabe-Taste wird die Maske zur Verfügung gestellt.

3.4.3.1.2 (B) Tabellarische Anzeige Information Aufgaben

```
TRAN: KVLI FC: IA SB: V#GS####A#EUR####

BOERSENGESCHAEFTE       I N F O R M A T I O N  AUFGABEN       SEITE    1

BESTAND VOM  28.10.2009            VERKAUF                   KONTO  7930

A  MAK SLTAG  GESNR   KURS     WKN              NOMINALE           AUSM.BETRAG
1 7835 26.10 1234567   100,000 DE0001051241          300               311,60
1 7817 26.10   24952    99,990 DE0001052052      100.000            102.338,61









-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 28/10/09 -- 08:08:08 --

PF3: Rücksprung  PF4: Abbruch  PF8: Vor
```

3.4.4 Kontroll- und Abstimmsummen (IK/IS)

3.4.4.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Die Kontroll- und Abstimmsummen dienen den Kreditinstituten und der Clearstream Banking AG, Frankfurt, zur Abstimmung und Übersicht über die Aktivitäten im Lieferbestand und über die Ergebnisse aus den damit zusammenhängenden Verarbeitungen. Die Anzeige der Kontroll- und Abstimmsummen kann nach Kauf- und Verkaufsseite selektiert werden

Die Funktion „Information Kontrollsummen" (IK) gibt Auskunft über die Freigaben und Rückstellungen, die Funktion „Information Abstimmsummen" (IS) über Restanten und Tagesgeschäfte. Dabei werden jeweils folgende Informationen bereitgestellt:

- die Anzahl der Geschäfte
- die Nominale
- der ausmachende Betrag
- der Saldo aus evtl. vorhandenen Kursdifferenzen

Daneben erfolgt eine Anzeige über Stornierungen und Löschungen sowie Courtage, Provision und Spesen.

Zusätzlich erfolgt eine Anzeige der Geldregulierung aus der SDS-Disposition.

Die Abstimmsummen werden nach jeder Disposition neu gebildet, während die Kontrollsummen unmittelbar nach Bearbeitung eines Geschäftes aktualisiert werden.

3.4.4.2 Kontrollsummen (IK)

Ausgehend vom Hauptauswahlmenü erfolgt der Einstieg durch Eingabe des Funktionscodes „LI" (Information/Online-Druck) in die Auswahlmaske „Information" und von dort durch Wahl des Funktionscodes „IK" zur Maske „Information Kontrollsummen". Der sog. Experteneinstieg ist aus jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode „KVLI" sowie den Funktionscode „IK" möglich. Die Anzeige der Kontrollsummen kann nach Kauf- und Verkaufsseite und Währung der Gegenwerte selektiert werden.

Nach dem Betätigen der Datenfreigabe-Taste wird die Maske zur Verfügung gestellt:

```
TRAN: KVLI FC: IK SB: V#GS#7930####EUR####

BOERSENGESCHAEFTE          I N F O R M A T I O N  KONTROLLSUMMEN

BESTAND VOM  28.10.2009   VERKAUF   GS           WRG: EUR        KONTO: 7930

                     ANZAHL      NOMINALE            AUSM.BETRAG  KURSDIFF.
SETTL.-SPERREN            2        60.100              60.918,82       0,00+

SETTL.-FREIGABEN          0             0                   0,00       0,00+
SETTL.-FREIG. KOMP.       0             0                   0,00       0,00+
SETTL.-FREIG. VAL.                                          0,00       0,00+

LOESCHUNGEN               0             0                   0,00       0,00+
STORNIERUNGEN             0             0                   0,00       0,00+

SUMME GESAMT              2        60.100              60.918,82       0,00+

DAVON SDS-FAEHIG          0             0                   0,00       0,00+


-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B793043G -- 28/10/09 -- 11:23:42 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

In die Position *„Settlement-Sperren"* fließen alle Geschäfte des Lieferbestandes ein, die durch eine Settlement-Sperre von der Disposition zurückgestellt worden sind.

Die Position *„Settlement-Freigaben"* enthält sowohl alle Restanten des Lieferbestandes, die durch eine Settlement-Freigabe in die nächste Disposition gelangen sollen, als auch alle Tagesgeschäfte mit einer Settlement-Freigabe, die in die abendliche Buchung gelangen sollen. In der Summe *„Settlement-Freigaben Kompensationen"* sind die freigegebenen Kompensationen enthalten.

Die Summe *„Settlement-Freigaben Valuta-Geschäfte"* enthält die Gegenwerte der Festvaluta-Geschäfte, die mit Erreichen des Valuta-Tages automatisch reguliert werden. Da die Transaktionsart „Festvaluta-Geschäft" nicht mehr existiert, wird diese Summenspalte nicht mehr gefüllt.

Bei den *„Löschungen"* handelt es sich um Geschäfte, auf die beide Kontrahenten ein Löschkennzeichen gesetzt haben. Nach erfolgter Löschung ist das Geschäft in den Abstimmsummen unter „Löschungen vom Vortag" aufgeführt.

In den *„Stornierungen"* sind erstmals die getätigten Stornierungen online verfügbar.

Die *„Summe gesamt"* setzt sich aus den Settlement-Sperren, den Settlement-Freigaben (einschließlich der Kompensationen und Valuta-Geschäfte) sowie den Löschungen zusammen.

Die Geschäfte des Lieferbestandes, die in der SDS-Verarbeitung reguliert werden können, werden in der Zeile *„Davon SDS-Fähig"* angezeigt. Diese Anzeige ist nur in der Zeit vom Beginn der Online-Transaktionen bis zum Beginn der SDS-Verarbeitung sichtbar.

Abstimmsummen (IS)

Ausgehend vom Hauptauswahlmenü erfolgt der Einstieg durch Eingabe des Funktionscodes „LI" (Information/Online-Druck) in die Auswahlmaske „Information" und von dort durch Wahl des Funktionscodes „IS" zur Maske „Information Abstimmsummen". Der sog. Experteneinstieg ist aus jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode KVLI sowie den Funktionscode „IS" möglich. Die Anzeige der Kontrollsummen kann nach Kauf- und Verkaufsseite und nach Währung der Gegenwerte selektiert werden.

Nach dem Betätigen der Datenfreigabe-Taste wird die Maske zur Verfügung gestellt:

```
TRAN: KVLI FC: IS SB: V#GS#7930####EUR####

BOERSENGESCHAEFTE          I N F O R M A T I O N  ABSTIMMSUMMEN

BESTAND VOM  28.10.2009   VERKAUF   GS           WRG: EUR        KONTO: 7930

                     ANZAHL      NOMINALE            AUSM.BETRAG  KURSDIFF.
RESTANTEN M. GEGW.        0             0                   0,00       0,00+
RESTANTEN O. GEGW.        0             0                   0,00       0,00+

RESTANTEN GESAMT          0             0                   0,00       0,00+

TAGESGES. M. GEGW.        2        60.100              60.918,82       0,00+
TAGESGES. O. GEGW.        0             0                   0,00       0,00+
TAGESGES. VAL.N.T.        0             0                   0,00       0,00+

TAGESGES.GES.O.KOM.       2        60.100              60.918,82       0,00+


SUMME GESAMT              2        60.100              60.918,82       0,00+

-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B793043G -- 28/10/09 -- 11:25:45 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Die Summe *„Restanten mit Gegenwert"* setzt sich aus folgenden Geschäften zusammen:

- Lieferpositionen, die mit einer Settlement-Sperre von der Disposition zurückgestellt wurden,
- Lieferpositionen, welche in der Disposition abgelehnt wurden.
- die gesperrten Lieferpositionen ohne Gegenwert
- Lieferpositionen ohne Gegenwert, welche in der Disposition abgelehnt wurden.
- Der Posten *„Restanten gesamt"* bildet die Summe aus den „Restanten mit Gegenwert" und den „Restanten ohne Gegenwert".
- In die Summe der *„Tagesgeschäfte mit Gegenwert"* fließen alle Lieferpositionen mit Gegenwert vom letzten aktuellen Börsentag (Vortag) ein. Kompensationen sind nicht enthalten.
- *„Tagesgeschäfte ohne Gegenwert"* sind die Lieferpositionen vom Vortag, die ohne Gegenwert erfasst wurden.

In den *„Tagesgeschäften Festvaluta nächster Tag"* sind die Festvaluta-Geschäfte des Vortages enthalten, bei denen heute - unabhängig von der Freigabe der Stücke - der Gegenwert reguliert wird. Erfolgt am Valutatag keine Freigabe der Stücke, wird das Geschäft ab dem Valuta-Datum als Restant ohne Gegenwert geführt. Da die Transaktionsart "Festvaluta-Geschäft" nicht mehr existiert, wird diese Summenspalte nicht mehr gefüllt.

Die Summe *„Tagesgeschäfte gesamt ohne Kompensationen"* wird gebildet aus den „Tagesgeschäften mit Gegenwert", den „Tagesgeschäften ohne Gegenwert" sowie den „Tagesgeschäften Valuta nächster Tag".

In der *„Summe gesamt"* sind alle Restanten und alle Tagesgeschäfte (ohne Kompensationen) enthalten.

Mit der Taste PF8 wird in die Folgemaske verzweigt:

```
TRAN: KVLI FC: IS SB: V#GS#7930####EUR####

BOERSENGESCHAEFTE          I N F O R M A T I O N  ABSTIMMSUMMEN

BESTAND VOM  28.10.2009   VERKAUF   GS           WRG: EUR        KONTO: 7930

                     ANZAHL      NOMINALE            AUSM.BETRAG  KURSDIFF.

COURTAGE                  1           100                   0,75       0,00+

PROVISION                 0             0                   0,00       0,00+
SPESEN                    0             0                   0,00       0,00+

STORNI. V. VORTAG         0             0                   0,00       0,00+
LOESCH. V. VORTAG         0             0                   0,00       0,00+


SDS GELDREGULIERT         0             0                   0,00       0,00+



-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B7930743G -- 28/10/09 -- 11:27:28 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

Die *Summen* für *„Courtage"*, *„Provision"* und *„Spesen"* beziehen sich nur auf die Tagesgeschäfte.

In den *„Stornierungen vom Vortag"* sind die vom Eingeber stornierten Tagesgeschäfte enthalten. Stornierungen werden einen weiteren Tag zur Information angezeigt.

Die *„Löschungen vom Vortag"* enthalten die Geschäfte, die am Vortag von beiden Kontrahenten gelöscht worden sind. Sie werden einen weiteren Tag zur Information angezeigt.

Die Zeile *„SDS Geld reguliert"* gibt die am aktuellen Tagesdatum in der SDS-Disposition geldseitig regulierten Geschäfte wieder. Diese Anzeige erscheint erst nach dem Ende der SDS-Disposition.

4 Abwicklung OTC-Geschäft

Unter der Erfassung ist die *Neueingabe von Aufträgen in den Erfassungsstatus* zu verstehen. Sie kann sowohl von den Kunden als auch von der CBF durchgeführt werden.

Durch Eingabe des Funktionscodes „CA" im Einstiegsmenü „Funktionsangebot für den Bereich Clearstream Banking AG, Frankfurt-Domestic" (siehe Band 1, Abschnitt 0) wird das Hauptauswahlmenü Auftragsabwicklung Wertpapiere in "CASCADE" aufgerufen:

```
TRAN: MENU FC:    SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          H A U P T A U S W A H L

       ERFASSUNGSSTATUS                     AUFTRAGSSTATUS

       EE   ERFASSUNG GIROBEREICH BANK      AM   MATCH-DIENST
       EW   ERFASSUNG WERTEBEREICH BANK     AS   SETTLEMENT-DIENST
       ED   ERFASSUNG CBF                   AI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK
       EA   AENDERUNG/LOESCHUNG GIROBER.    AA   AENDERUNG/LOESCHUNG
       EB   AENDERUNG/LOESCHUNG WERTEBER.   AR   RESERVIERUNGS-DIENST
       EI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK        AC   SELBSTBESICHERUNG
       EK   KONTROLLE GIROBEREICH           AN   NOTFALL-DIENST
       EC   KONTROLLE WERTEBEREICH

       BOERSENGESCHAEFTSABWICKLUNG

       LS   SETTLEMENT BEARBEITUNG
       LA   AENDERUNG/LOESCHUNG
       LI   INFORMATION/ONLINE-DRUCK

-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79073FX -- 19/11/14 -- 11:00:26 --

KV0005I Funktion beendet, bitte wählen Sie aus
```

Ausgehend von dem Hauptauswahlmenü gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes „EE" zum Auswahlmenü der Erfassung:

```
TRAN: KVEE FC:    SB:

 AUFTRAGSABWICKLUNG      E R F A S S U N G  GIROBEREICH BANK    ERFASSUNGSSTATUS


 WE   WP-UEBERTRAG EINZEL                          LE   LSV-UEBERTRAG
 WM   WP-UEBERTRAG MEHRFACH                        BE   BSV-UEBERTRAG EINZEL
 MI   MATCH-INSTRUKTION WP-UEBERTRAG
                                                   UT   UMTAUSCH
 BV   BESTANDSUEBERTRAG                            RT   RUECKTAUSCH
 DV   DEPOTUEBERTRAG
                                                   OT   OPTIONSSCHEINTRENNUNG
 TD   TEFRA-D FREIGABE                             OZ   OPTIONSSCHEINZUSAMMENF.

                                                   SA   STRIP-AUFTEILUNG
                                                   SZ   STRIP-ZUSAMMENFUEHRUNG




 -- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79074E4 -- 19/11/14 -- 13:59:33 --

 PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Kunden der CBF können die folgenden Funktionscodes nutzen:

WE	=	WP-Übertrag einzeln
WM	=	WP-Übertrag mehrfach
MI	=	Match-Instruktion zu einem WP-Übertrag
BV	=	Bestandsübertrag (nur für Namensaktien-RS) ohne Gegenwert
DV	=	Depotübertrag (nur für Namensaktien-RS) ohne Gegenwert
TD	=	Freigabe von TEFRA D Wertpapierbeständen
LE	=	LSV-Übertrag (Landesschuldbuch) ohne Gegenwert
BE	=	BSV-Übertrag (jetzt: Deutsche Finanzagentur) ohne Gegenwert
UT	=	Umtausch GBC
RT	=	Rücktausch GBC
OT	=	Optionsscheintrennung
OZ	=	Optionsscheinzusammenführung
SA	=	Strip-Aufteilung
SZ	=	Strip-Zusammenführung

Die Funktionscodes BV und DV stellen Services für Namensaktien dar und werden in Band 2 unter Kapitel 3 erläutert.

4.1 Auftragserteilung (EE)

4.1.1 Einzelerfassung von Wertpapier-Überträgen mit/ohne Gegenwert (Kontrahent im Inland) (WE)

Folgende WP-Überträge werden hier erfasst:

4.1.1.1 WP-Übertrag Inland, d. h.

Bei einem Wertpapierübertrag Inland ist der Kontrahent direkt Teilnehmer bei CBF.

Es sind folgende Auftragserteilungen möglich:

- WP-Übertrag Inland ohne Gegenwert (Match-Auftrag)
- WP-Übertrag Inland mit Gegenwert EUR (Match-Auftrag)
- WP-Übertrag Inland mit Gegenwert zugelassene Fremdwährung (Match-Auftrag)

4.1.1.2 WP-Übertrag Ausland (Cross-Border), d. h.

Bei einem Wertpapierübertrag Ausland ist der Kontrahent Teilnehmer bei einem ausländischen Zentralverwahrer (CSD bzw. ICSD).

Es sind folgende Auftragserteilungen möglich:

- WP-Übertrag Ausland ohne Gegenwert (Match-Auftrag)
- WP-Übertrag Ausland mit Gegenwert EUR (Match-Auftrag)
- WP-Übertrag Ausland mit Gegenwert zugelassene Fremdwährung (Match-Auftrag)

4.1.1.3 Einzelerfassung von WP-Übertrag Inland bzw. Ausland

Es ergeben sich hierdurch Unterschiede bei der Folgeerfassung von erforderlichen Daten bei WP-Überträgen (Folgeerfassung). Es wird zusätzlich nachfolgende Unterteilung vorgenommen:

- Einzelerfassung (Kontrahent im Inland)
- Einzelerfassung (Kontrahent im Ausland)

4.1.1.4 Basisdaten

4.1.1.4.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Die Einzelerfassung sollte immer dann gewählt werden, wenn WP-Überträge mit umfangreichen zusätzlichen Informationen für den Begünstigten zu erfassen sind.

Nach Eingabe des Funktionscodes „WE" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird die zweiseitige Maske zur Erfassung der Basisdaten zur Verfügung gestellt.

4.1.1.4.2 (B) Eingabemaske Einzelerfassung

```
TRAN: KVEE FC: WE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG            ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: ____           AUFTNR: _________      VWA: GS        TR: _

LAST     : ___________                                        /
GUT      :                                                    /
WKN      : I

NOMINALE :                        EINHEIT:           DISPO-PRIORITAET: 4 MST
GEGENWERT: ______________________ WRG    : EUR       PARTY-HOLD (J/N): N
DCA/REF  :                                           EMISS-EINF (J/N): N

SET-DAY  : 20.11.2014             EX-TRD : _         BATM/ADEA  (J/N): N
BOERSENPL: ____                   OPT-OUT:           RTS-DVP    (J/N): N

SCHLUSSTAG: __________            REFERENZ-NR      : _________________
KURS / WRG: ___________ ___       AUFTRAGS-REFERENZ:
                                  GEGEN-AUFTNR     :

-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B793058S -- 19/11/14 -- 14:37:15 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu
```

4.1.1.4.3 (C) Feldbesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines WP-Übertrages (Basisdaten) sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	vorbelegt mit:
AUFTNR	
VWA	„GS" = Girosammelverwahrung
LAST	Bank-Nr. des erfassenden Kunden der CBF
GUT	
WKN-KENNUNG	„I" (änderbar in "W")
WKN	
NOMINALE	
DISPO-PRIORITAET	„4 MST"
SET-DAY	nächster Bankarbeitstag
RTS-DVP	„N" = NEIN
EMISS-EINF	„N" = NEIN
PARTY HOLD	„N" = NEIN
SCHLUSSTAG	

Neben den allgemeingültigen Feldbeschreibungen (vgl. Kapitel 2.3.7

Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen) gelten bei der Einzelerfassung eines WP-Übertrages folgende Feldbesonderheiten:

PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld PRIMANOTE mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren inkl. der Aufträge für den Wertebereich.
TR	Für die Übertragung von Teilrechte- in Vollrechte-Konten oder von Vollrechte- in Teilrechte-Konten sind folgende Ausprägungen möglich: 1 = Teilrechte in Vollrechte 2 = Vollrechte in Teilrechte 3 = Spitzenkonten in Vollrechte 4 = Vollrechte in Spitzenkonten 5 = Spitzenkonten in Vollrechte 6 = Vollrechte in Spitzenkonten
LAST / GUT	Die in den Feldern LAST / GUT eingegebenen Kontonummern müssen unter den folgenden Kontoarten sein: • Kundenkonten, • Verfügungskonten Bundesbank, • Rückgabekonten Bundesbank und ihren Niederlassungen, • Kundenkonten Treuhand/Vorratslager/Rückgabe, • Abwicklungskonto für Teilrechte. Die Felder Last- und Gutschriftkonto können identisch sein.
DISPO-PRIORITAET	Folgende Ausprägungen sind möglich: 1 = für Batchverarbeitung - sehr hoch 2 = für Batchverarbeitung - hoch 3 = für Batchverarbeitung - mittel 4 = für Batchverarbeitung - Standard (= Vorbelegung) Vergleiche auch die ausführliche Beschreibung zu den Auswirkungen der einzelnen Dispositionsprioritäten und Settlementarten in Kapitel 0.
GEGENWERT	Das Feld GEGENWERT ist nur bei WP-Überträgen mit Gegenwert zu füllen.
WRG	Pflichtfeld bei Aufträgen mit Gegenwert. Zugelassene Fremdwährungen (z. B. USD, AUD, ...) sind entsprechend zu erfassen. Bei Gegenwertverrechnung in Schweizer Franken (CHF) und Einbeziehung eines Wertpapieres mit CH-ISIN ist die Beschreibung im CBF Customer Handbook (Kapitel 4.3) zu berücksichtigen.
DCA/REF	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
SET-DAY	Der SET-DAY kann auch in die Zukunft erfasst werden.
EX TRD	Die „Ex" Kennzeichnung für die Verarbeitung von Kompensationen kann hier eingegeben werden (J oder N). Der Standardwert „leer" wird ohne Eingabe als "N" interpretiert.
BATM/ADEA	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
BOERSENPL	Der Börsenplatz ist zurzeit noch nicht nutzbar.
OPT-OUT	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.

RTS-DVP	Folgende Ausprägungen sind möglich: „J" für RTS mit Gegenwert EUR (Sofortdisposition) „N" für STD und SDS- Batchverarbeitung (Massendisposition) und Cont-SDS
SCHLUSSTAG	Der Tag, an dem die Endteilnehmer das WP-Geschäft/Börsengeschäft abgeschlossen haben (Trade-date).
AUFTRAGS-REFERENZ	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
GEGEN-AUFTNR	Hier kann die Gegenauftragsnummer für die Auftragsart 01/02 eingetragen werden. Die Eingabe unterstützt das Direkt-Matching

4.1.1.4.4 (D) Eingabemaske Einzelerfassung-2

Sind die Mussfelder (vgl. Abschnitt C) ausgefüllt, so wechselt PF8 auf die zweite Seite der Eingabemaske:

```
TRAN: KVEE FC: WE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG-2           ERFASSUNGSSTATUS

                 PRIMANOTE:  100     AUFTNR:         1     WKN: I DE0001135218

UEB-GRUND  : ___

EXT SET-DAY: __________              RUECKUEBERTRAG (J/N)    : N
ALREADY MATCHED (J/ ):               PARTIAL SETTL.INDICATOR:
ISO TRANSACTION CODE :

BELEGSCHAFT-SP: N                    SP-DATUM:
KUPONINFO/RECORD-DATE: __________



TEXT:


-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B793058S -- 19/11/14  -- 14:41:25 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

4.1.1.4.5 (E) Feldbesonderheiten

UEB-GRUND	In diesem Feld kann für den Begünstigten die fachliche Zuordnung des Auftrages angegeben werden
EXT SET-DAY	Tatsächlicher Settlement-Tag, wenn abweichend von ursprünglichem Settlement-Tag.
ALREADY MATCHED	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
PARTIAL SETTL INDICATOR	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
ISO TRANSACTION CODE	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.

4.1.1.4.6 (F) Abhängigkeitsprüfungen

TR / GUT / WKN

Wenn TR = 01, dann wird das GUT automatisch vom System ermittelt (Eingeber = LAST). Darüber hinaus muss die im Feld WKN eingegebene Teilrechte-WKN noch in der festgelegten Umwandlungsfrist (von Teilrechte in Vollrechte) liegen. Bei Namensaktien (RS) werden die Vollrechte immer in den freien Meldebestand mit KE-Typ eingebucht.

Wenn TR = 02, dann wird das GUT automatisch vom System ermittelt (Eingeber = LAST). Darüber hinaus muss die im Feld WKN eingegebene Vollrechte-WKN noch in der festgelegten Umwandlungsfrist (von Vollrechte in Teilrechte) liegen. Bei Namensaktien (RS) werden die Vollrechte immer aus dem freien Meldebestand mit KE-Typ ausgebucht.

Wenn TR = 03, dann wird das GUT automatisch vom System ermittelt (Eingeber = LAST). Darüber hinaus muss die im Feld WKN eingegebene Aktienspitze/Aktienanrechte WKN noch in der festgelegten Umwandlungsfrist liegen. Bei Namensaktien (RS) werden die Vollrechte immer in den freien Meldebestand ohne KE-Typ eingebucht.

Wenn TR = 04, dann wird das GUT automatisch vom System ermittelt (Eingeber = LAST). Darüber hinaus muss die im Feld WKN eingegebene Aktienspitze/Aktienanrechte WKN noch in der festgelegten Umwandlungsfrist liegen. Bei Namensaktien (RS) werden die Vollrechte immer aus dem freien Meldebestand ohne KE-Typ ausgebucht.

Wenn TR = 05, dann wird das GUT automatisch vom System ermittelt (Eingeber = LAST). Darüber hinaus muss die im Feld WKN eingegebene Aktienspitze/Aktienanrechte WKN noch in der festgelegten Umwandlungsfrist liegen.

Wenn TR = 06, dann wird das GUT automatisch vom System ermittelt (Eingeber = LAST). Darüber hinaus muss die im Feld WKN eingegebene Aktienspitze/Aktienanrechte WKN noch in der festgelegten Umwandlungsfrist liegen.

Die Zusatzbuchung wird jeweils automatisch erstellt und mit der Freigabetaste in der Informationszeile angezeigt.

TR / GEGENWERT

Wenn das Feld TR gefüllt wurde, kann kein Gegenwert eingetragen werden.

GEGENWERT / WRG

Bei Überträgen mit Gegenwert muss das Feld WRG gefüllt sein.

SET-DAY / RTS-DVP:

Nach 16:00 Uhr kann kein Auftrag mit RTS-DVP = J gegen EUR mit einer Valuta kleiner oder gleich dem Tagesdatum eingegeben werden. Eingaben mit einem zukünftigen Datum sind möglich.

4.1.1.5 Folgedaten

4.1.1.5.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Sollen bzw. müssen hinsichtlich eines WP-Übertrages noch weitere Daten erfasst werden, so ist mit PF8 die Folgeerfassungsmaske aufzurufen.

4.1.1.5.2 (B) Folgemaske WP-Übertrag

```
TRAN: KVEE FC: WE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / SETL.PTY-ERFASSUNG    ERFASSUNGSSTATUS

                 PRIMANOTE:  100     AUFTNR:         1     WKN: I DE0001135218

SETTL PARTY - LIEFERER
P1:
P2: ___ ____________________________________________________________________________
P3: ___ ____________________________________________________________________________
P4:
P5: ___ ____________________________________________________________________________

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1: ___________  ___________________________________
P2:
P3: ___ ____________________________________________________________________________
P4: ___ ____________________________________________________________________________
P5:


-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B793058S -- 19/11/14  -- 14:42:16 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu  PF7:Zurück
```

Nach Datenfreigabe werden die eingegebenen Daten auf formale Richtigkeit und Plausibilität geprüft und ausgerichtet. Fehler werden angezeigt und müssen korrigiert werden. Erst wenn alle Daten korrekt sind, erscheint in Zeile 24 die Aufforderung, die Verarbeitung mit PF3 zu bestätigen. Jede Seite muss einzeln mit PF3 verarbeitet werden.

Im Unterschied zur Nutzung der Taste PF3 ermöglicht eine Nutzung der Taste PF6, dass die eingegebenen Daten nach der Verarbeitung weiterhin auf dem Bildschirm angezeigt werden und somit wieder verwendet werden können. Anschließend kann dann z. B. durch Überschreiben eines Feldes und erneutes Verarbeiten durch PF3 (oder PF6) ein weiterer Auftrag generiert werden.

4.1.1.5.3 (C) Feldbesonderheiten

Bei WP-Überträgen gegen Zahlung (DvP) mit einem Kontrahenten im Inland sind die Felder der Folgemaske als Kann Felder definiert. Bei Überträgen frei von Zahlung (FoP) mit einem Kontrahenten im Inland sind diese Felder zum Teil als Mussfelder definiert.

PRIMANOTE / AUFTNR / WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
SETTL PARTY - LIEFERER: P1	Bei WP-Überträgen mit Kontrahent im Inland entspricht die Information dem Last-Konto der Instruktion. Falls zu dem entsprechenden Konto bereits ein SAC hinterlegt ist, wird dieser angezeigt, andernfalls bleibt das Feld leer. Eine Eingabe ist nicht möglich.
SETTL PARTY - LIEFERER: P2 – P5	Bei DvP WP-Überträgen mit Kontrahent im Inland ist die Eingabe optional, erlaubt sind die Attribute KTO, ACC, BIC und BLZ. Für das Befüllen gibt es je nach gewähltem Level genaue Vorgaben zu Inhalt und Reihenfolge (siehe entsprechendes Eingabeschema). Freie Felder können mit dem Attribut TXT für Freitext genutzt werden (z.B. Name und Adresse).
SETTL PARTY - EMPFAENGER: P1	Bei WP-Überträgen mit Kontrahent im Inland entspricht die Information dem Gut-Konto der Instruktion. Falls zu dem entsprechenden Konto bereits ein SAC hinterlegt ist, wird dieser angezeigt, andernfalls bleibt das Feld leer. Eine Eingabe ist nicht möglich.
SETTL PARTY - EMPFAENGER: P2 – P5	Bei DvP WP-Überträgen mit Kontrahent im Inland ist die Eingabe optional, erlaubt sind die Attribute KTO, ACC, BIC und BLZ. Für das Befüllen gibt es je nach gewähltem Level genaue Vorgaben zu Inhalt und Reihenfolge (siehe entsprechendes Eingabeschema). Bei FoP WP-Überträgen mit Kontrahent im Inland muss die Teilnehmerinformation des endbegünstigten Kunden (KTO, ACC, BIC oder BLZ) angegeben werden. Bitte beachten Sie, dass die automatische Erkennung von Retailgeschäften für das Aktiv- und Passivmatching anhand der BLZ lediglich in P2 unterstützt wird. Freie Felder können mit dem Attribut TXT für Freitext genutzt werden (z.B. Name und Adresse).

Eingabeschema KVEE/WE: SETTL PARTY – LIEFERER (im Inland)					
	5 Level	4 Level	3 Level	2 Level	1 Level
P1 Konto	Last-Konto* (DEAG)				
P2	Auftraggebender Intermediär 1 (DEI1)	Auftraggebender Intermediär 1 (DEI1)	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)	
P3	Auftraggebender Intermediär 2 (DEI2)	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)		
P4	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)			
P5	Original-Auftraggeber (SELL)				

* wird aus der Grundmaske übernommen, falls zu dem entsprechenden Konto bereits ein SAC hinterlegt ist

Eingabeschema KVEE/WE: SETTL PARTY – EMPFAENGER (im Inland)					
	5 Level	4 Level	3 Level	2 Level	1 Level
P1 Konto	Gut-Konto* (REAG)				
P2	Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)	
P3	Begünstigter Intermediär 2 (REI2)	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)		
P4	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)			
P5	Endbegünstigter (BUYR)				

* wird aus der Grundmaske übernommen, falls zu dem entsprechenden Konto bereits ein SAC hinterlegt ist.

4.1.1.5.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

P2 – P5

Wird das Präfix mit KTO, ACC, BLZ oder BIC gefüllt, so erwartet das System die Eingabe einer zugehörigen Schlüsselnummer.

4.1.2 Einzelerfassung von Wertpapier-Überträgen mit/ohne Gegenwert (Kontrahent im Ausland) (WE)

4.1.2.1 Basisdaten

4.1.2.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

WP-Überträge an ausländische Zentralverwahrer oder Clearinghäuser müssen über die Einzelerfassung eingegeben werden. Eine detaillierte und nach einzelnen Ländern aufgeschlüsselte Erläuterung der benötigten Eingaben in KVEE/WE findet sich auf der Clearstream Website im jeweiligen CASCADE Link Guide unter Products and Services / Market coverage.

Nach Eingabe des Funktionscodes „WE" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird die zweiseitige Maske zur Erfassung der Basisdaten zur Verfügung gestellt.

4.1.2.1.2 (B) Eingabemaske WP-Übertrag Einzelerfassung Ausland

```
TRAN: KVEE FC: WE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG            ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: ____           AUFTNR: _________      VWA: GS        TR: _

LAST     :                                                    /
GUT      : ___________                                        /
WKN      : I ____________

NOMINALE :    ____________________   EINHEIT:           DISPO-PRIORITAET: 4 MST
GEGENWERT:                           WRG    : EUR       PARTY-HOLD (J/N): N
DCA/REF  :                                              EMISS-EINF (J/N): N

SET-DAY  : 20.11.2014                EX-TRD :           BATM/ADEA  (J/N): N
BOERSENPL:                           OPT-OUT:           RTS-DVP    (J/N): N

SCHLUSSTAG:                          REFERENZ-NR      :
KURS / WRG: ___________ ___          AUFTRAGS-REFERENZ:
                                     GEGEN-AUFTNR     : _________

-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B79073FX -- 19/11/14 -- 12:24:47 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu
```

4.1.2.1.3 (C) Feldbesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines WP-Übertrages (Basisdaten) sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	vorbelegt mit:
AUFTNR	
VWA	"GS" = Girosammelverwahrung
LAST	Bank-Nr. des erfassenden Kunden der CBF
GUT	
WKN-KENNUNG	"I" (änderbar in "W")
WKN	
NOMINALE	
DISPO-PRIORITAET	„4 MST"
SET-DAY	nächster Bankarbeitstag
RTS-DVP	"N" = NEIN
EMISS-EINF	"N" = NEIN
PARTY HOLD	"N" = NEIN

Neben den allgemeingültigen Feldbeschreibungen (vgl. Kapitel 2.3.7

Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen) gelten bei der Einzelerfassung eines WP-Übertrages mit Kontrahent im Ausland folgende Feldbesonderheiten:

PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld PRIMANOTE mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren inkl. der Aufträge für den Wertebereich.
LAST / GUT	Falls CBF an einen anderen CSD liefert gilt: LAST muss aus Kontengruppe 01 (Kundendepot nur H) sein, GUT muss aus der Kontengruppe 15 (Lagerstellen Ausl.) sein. Falls CBF von einem anderen CSD beliefert wird gilt: LAST muss aus Kontengruppe 15 (Lagerstellen Ausl.)) sein, GUT muss aus der Kontengruppe 01 (Kundendepot nur H) sein. Nähere Informationen dazu finden sich im jeweiligen CASCADE Link Guide.
DISPO-PRIORITAET	Folgende Ausprägungen sind möglich: 1 = für Batchverarbeitung - sehr hoch 2 = für Batchverarbeitung - hoch 3 = für Batchverarbeitung - mittel 4 = für Batchverarbeitung - Standard (= Vorbelegung) Vergleiche auch die ausführliche Beschreibung zu den Auswirkungen der einzelnen Dispositionsprioritäten und Settlementarten in Kapitel 0.
GEGENWERT	Das Feld GEGENWERT ist nur bei WP-Überträgen mit Gegenwert (DvP) zu füllen.
WRG	Pflichtfeld bei Aufträgen mit Gegenwert. Hier wird das entsprechende Währungskürzel eingetragen. Bei Gegenwertverrechnung in Schweizer Franken (CHF) und Einbeziehung eines Wertpapieres mit CH-ISIN ist die Beschreibung im CBF Customer Handbook (Kapitel 4.3) zu berücksichtigen.
DCA/REF	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
SET-DAY	Der SET-DAY kann auch in die Zukunft erfasst werden.
RTS-DVP	Folgende Ausprägungen sind möglich: „J" für RTS mit Gegenwert EUR (Sofortdisposition) „N" für STD und SDS- Batchverarbeitung (Massendisposition) und Cont-SDS
EX TRD	Die „Ex" Kennzeichnung für die Verarbeitung von Kompensationen kann hier eingegeben werden (J oder N). Der Standardwert „leer" wird ohne Eingabe als "N" interpretiert.
BATM/ADEA	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
BOERSENPL	Der Börsenplatz ist zurzeit noch nicht nutzbar.
OPT-OUT	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
REFERENZ-NR	Wird der Referenz Nr. von beiden Kontrahenten identisch gefüllt, ist sie Match-Kriterium im ESES Markt. Im Falle eines leeren Feldes wird CBF für Instruktionen in die ESES Märkte das Feld automatisch mit der vierstellige Konto-Nr. gefolgt von 0000 befüllen (bsp. 79300000).
AUFTRAGS-	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.

REFERENZ	
GEGEN-AUFTNR	Hier kann die Gegenauftragsnummer für die Auftragsart 01/02 eingetragen werden. Die Eingabe unterstützt das Direkt-Matching.

4.1.2.1.4 (D) Eingabemaske Einzelerfassung-2

Sind die Mussfelder (vgl. Abschnitt C) ausgefüllt, so wechselt PF8 auf die zweite Seite der Eingabemaske:

```
TRAN: KVEE FC: WE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG-2           ERFASSUNGSSTATUS

                 PRIMANOTE:          AUFTNR:        13     WKN: I DE000A0Z17A1

UEB-GRUND  : ___

EXT SET-DAY: __________              RUECKUEBERTRAG (J/N)    : N
ALREADY MATCHED (J/ ):               PARTIAL SETTL.INDICATOR:
ISO TRANSACTION CODE :

BELEGSCHAFT-SP: N                    SP-DATUM:
KUPONINFO/RECORD-DATE: __________



TEXT:


-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79073FX -- 19/11/14   -- 12:25:47 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

4.1.2.1.5 (E) Feldbesonderheiten

UEB-GRUND	In diesem Feld kann für den Begünstigten die fachliche Zuordnung des Auftrages angegeben werden – siehe CASCADE Handbuch Band 2, Anhang „Uebertrag Grund“
EX SET DAY	Tatsächlicher Settlement-Tag, wenn abweichend von ursprünglichem Settlement-Tag.
ALREADY MATCHED	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
PARTIAL SETTL INDICATOR	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
ISO TRANSACTION CODE	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.

4.1.2.1.6 (F) Abhängigkeitsprüfungen

GEGENWERT / WRG

Bei Überträgen mit Gegenwert muss das Feld WRG gefüllt sein.

SET-DAY / RTS-DVP

Nach 16:00 Uhr kann kein Auftrag mit RTS-DVP = J gegen EUR mit einer Valuta kleiner oder gleich dem Tagesdatum eingegeben werden. Eingaben mit einem zukünftigen Datum sind möglich.

4.1.2.2 Folgedaten

4.1.2.2.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Bei der WP-Übertragung mit Kontrahenten im Ausland müssen zusätzliche Daten in einer Folgemaske eingegeben werden. Eine detaillierte Beschreibung findet sich im jeweiligen CASCADE Market Guide.

4.1.2.2.2 (B) Folgemaske WP-Übertrag Ausland

```
TRAN: KVEE FC: WE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / SETL.PTY-ERFASSUNG    ERFASSUNGSSTATUS

                 PRIMANOTE:          AUFTNR:        13     WKN: I DE000A0Z17A1

SETTL PARTY - LIEFERER
P1:
P2: ___ ____________________________________________________________________
P3: ___ ____________________________________________________________________
P4:
P5: ___ ____________________________________________________________________

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1: ___________  ___________________________________
P2:
P3: ___ ____________________________________________________________________
P4: ___ ____________________________________________________________________
P5:


-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79073FX -- 19/11/14 -- 12:26:21 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu  PF7:Zurück
```

4.1.2.2.3 (C) Feldbesonderheiten

Neben den allgemeingültigen Feldbeschreibungen (vgl. Kapitel 2.3.7

Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen) gelten bei der Einzelerfassung eines WP-Übertrages folgende Feldbesonderheiten:

PRIMANOTE / AUFTR / WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
SETTL PARTY - LIEFERER: P1-P5	**Lieferer im Inland:** In P1 ist keine Eingabe möglich. Die Eingabe von P2 – P5 ist optional, erlaubt sind die Attribute KTO, ACC, BIC und BLZ. Für das Befüllen gibt es je nach gewähltem Level genaue Vorgaben zu Inhalt und Reihenfolge (siehe entsprechendes Eingabeschema). **Lieferer im Ausland:** P1 ist ein Pflichtfeld, wenn bei LAST-KTO die Kto-Nr. eines CSD bzw. ICSD (Kontengruppe 15; Lagerstelle Ausland) eingetragen wurde. In diesem Fall ist eine gültige Kontonummer/BIC bei dem CSD/ICSD in P1 zu erfassen. Details hierzu und mögliche weitere Pflichtangaben (P2 – P5) sind dem jeweiligen CASCADE Link Guide zu entnehmen. In Kombination mit eventuell gewünschten Angaben ist das passende Eingabeschema aus der entsprechenden Tabelle auszuwählen. Freie Felder können mit dem Attribut TXT für Freitext genutzt werden (z.B. Name und Adresse).
SETTL PARTY - EMPFAENGER: P1 – P5	**Empfänger im Inland:** In P1 ist keine Eingabe möglich. Die Eingabe von P2 – P5 ist optional, erlaubt sind die Attribute KTO, ACC, BIC und BLZ. Für das Befüllen gibt es je nach gewähltem Level genaue Vorgaben zu Inhalt und Reihenfolge (siehe entsprechendes Eingabeschema). **Empfänger im Ausland:** P1 ist ein Pflichtfeld, wenn bei GUT-KTO die Kto-Nr. eines CSD bzw. ICSD (Kontengruppe 15; Lagerstelle Ausland) eingetragen wurde. In diesem Fall ist eine gültige Kontonummer/BIC bei dem CSD/ICSD in P1 zu erfassen. Details hierzu und mögliche weitere Pflichtangaben (P2 – P5) sind dem jeweiligen CASCADE Link Guide zu entnehmen. In Kombination mit zusätzlich gewünschten Angaben ist das passende Eingabeschema aus der entsprechenden Tabelle auszuwählen. Freie Felder können mit dem Attribut TXT für Freitext genutzt werden (z.B. Name und Adresse).

Eingabeschema KVEE/WE: SETTL PARTY – LIEFERER (im Inland)					
	5 Level	4 Level	3 Level	2 Level	1 Level
P1 Konto	Last-Konto* (DEAG)				
P2	Auftraggebender Intermediär 1 (DEI1)	Auftraggebender Intermediär 1 (DEI1)	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)	
P3	Auftraggebender Intermediär 2 (DEI2)	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)		
P4	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)			
P5	Original-Auftraggeber (SELL)				

* wird aus der Grundmaske übernommen, falls zu dem entsprechenden Konto bereits ein SAC hinterlegt ist

Eingabeschema KVEE/WE: SETTL PARTY – LIEFERER (im Ausland)					
	5 Level	4 Level	3 Level	2 Level	1 Level
P1 BIC	BIC Auftrag-gebender Intermediär 1 (DEI1)	BIC Auftrag-gebender Intermediär 1 (DEI1)	BIC Auftrag-gebender Intermediär 1 (DEI1)	BIC Auftrag-gebende Depotbank (DECU)	BIC Original-Auftraggeber (SELL)
P1 Konto	Konto Auftrag-gebender Intermediär 1 (DEI1)	Konto Auftrag-gebender Intermediär 1 (DEI1)	Konto Auftrag-gebender Intermediär 1 (DEI1)	Konto Auftrag-gebende Depotbank (DECU)	Konto Original-Auftraggeber (SELL)
P2	Auftraggebender Intermediär 2 (DEI2)	Auftraggebender Intermediär 2 (DEI2)	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)	
P3	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)		
P4	(:70E::DECL/// DLP4)	Original-Auftraggeber (SELL)			
P5	Original-Auftraggeber (SELL)				

Eingabeschema KVEE/WE: SETTL PARTY – EMPFAENGER (im Inland)					
	5 Level	4 Level	3 Level	2 Level	1 Level
P1 Konto	Gut-Konto* (REAG)				
P2	Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)	
P3	Begünstigter Intermediär 2 (REI2)	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)		
P4	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)			
P5	Endbegünstigter (BUYR)				

* wird aus der Grundmaske übernommen, falls zu dem entsprechenden Konto bereits ein SAC hinterlegt ist

Eingabeschema KVEE/WE: SETTL PARTY – EMPFAENGER (im Ausland)					
	5 Level	4 Level	3 Level	2 Level	1 Level
P1 BIC	BIC Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	BIC Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	BIC Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	BIC Begünstigte Depotbank (RECU)	BIC Endbegünstigter (BUYR)
P1 Konto	Konto Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Konto Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Konto Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Konto Begünstigte Depotbank (RECU)	Konto Endbegünstigter (BUYR)
P2	Begünstigter Intermediär 2 (REI2)	Begünstigter Intermediär 2 (REI2)	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)	
P3	Begünstigte Depotbank (RECU)	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)		
P4	(:70E::DECL/// RCP4)	Endbegünstigter (BUYR)			
P5	Endbegünstigter (BUYR)				

4.1.2.2.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

P2 – P5

Wird das Präfix mit KTO, ACC, BLZ oder BIC gefüllt, so erwartet das System die Eingabe einer zugehörigen Schlüsselnummer.

4.1.3 Mehrfacherfassung von Wertpapier-Überträgen mit/ohne Gegenwert (Kontrahent im Inland) (WM)

4.1.3.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Bei der Mehrfacherfassung können mehrere WP-Überträge mit und ohne Gegenwert auf einem Bildschirm eingegeben werden. Hierbei werden in jeweils einer Zeile nur die Standard-Angaben zu einem Auftrag erfasst.

Im Rahmen der Mehrfacherfassung spricht man von der sachlichen Sammelerfassung, wenn mehrere Aufträge die gleiche Wertpapierkennung aufweisen. Demgegenüber liegt eine persönliche Sammelerfassung vor, wenn sich mehrere Aufträge in dem Feld Gutschrift-Konto gleichen. Zur Vereinfachung der Erfassung können diese gleichen Feldinhalte aus der ersten Kopfzeile der Mehrfacherfassungsmaske in die einzelnen Eingabereihen kopiert werden.

Über die Mehrfacherfassung können nur WP-Überträge mit oder ohne Gegenwert an deutsche Kunden der CBF eingegeben werden. WP-Überträge an ausländische Zentralverwahrer oder Clearinghäuser müssen über die Einzelerfassung eingegeben werden.

Bei der Mehrfacherfassung sind die in den Zeilen EMPF-P2 oder UEB-G eingegebenen Zusatzinformationen für alle auf dieser Maske erfassten Aufträge gültig.

Es gibt keine Folgemasken.

Mit dem Aufruf des Funktionscodes „WM" wird eine vorbelegte Eingabemaske zur Verfügung gestellt.

4.1.3.1.2 (B) Tabellarische Anzeige/Mehrfacherfassung

```
TRAN: KVEE FC: WM SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG       WP-UEBERTRAG / MEHRFACHERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS

PN: ____ LAST-KTO : 7930 ___ GUT-KTO: ____ ___    WKN: I ____________ UEB-G: ___
EMISS-EINF(J/N): N  SCHLUSSTAG : __________  SET-DAY: 20.11.2014     OPT-OUT:
RTS-DVP   (J/N): N  REFERENZ-NR: _________________     PARTY-HOLD (J/N): N
EMPF-P1: ___________ ____________________________________            WRG  : EUR
EMPF-P2: ___ ____________________________________________________________________
TEXT   : ____________________________________________________________________

   AUFTNR LAST-KTO GUT-KTO  WKN                NOMINALE                GEGENWERT
_________ ____ ___ ____ ___ ____________ ___________________ ____________________



_________ ____ ___ ____ ___ ____________ ___________________ ____________________



_________ ____ ___ ____ ___ ____________ ___________________ ____________________


-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79074E4 -- 19/11/14 -- 15:28:35 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

4.1.3.1.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

```
TRAN: KVEE FC: WM SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG       WP-UEBERTRAG / MEHRFACHERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS

PN: ____ LAST-KTO : 7930 ___ GUT-KTO: ____ ___   WKN: I DE0005752000 UEB-G: ___
EMISS-EINF(J/N): N  SCHLUSSTAG : __________  SET-DAY: 20.11.2014     OPT-OUT:
RTS-DVP   (J/N): N  REFERENZ-NR: _________________     PARTY-HOLD (J/N): N
EMPF-P1: ___________ ___________________________                  WRG  : EUR
EMPF-P2: ___ ____________________________________________________________
TEXT   : ____________________________________________________________

   AUFTNR LAST-KTO GUT-KTO  WKN                NOMINALE               GEGENWERT

          7930 000          DE0005752000
__________ 7930 000 ____ ___ DE0005752000 ___________________ ___________________
__________ 7930 000 ____ ___ DE0005752000 ___________________ ___________________
          7930 000          DE0005752000
__________ 7930 000 ____ ___ DE0005752000 ___________________ ___________________
          7930 000          DE0005752000
          7930 000          DE0005752000
__________ 7930 000 ____ ___ DE0005752000 ___________________ ___________________

-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 08:23:34 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Bei der Erfassung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	Bedeutung
AUFTNR	Auftragsnummer
LAST-KTO	Lastschrift-Konto
GUT-KTO	Gutschrift-Konto
WKN	Wertpapierkennnummer/ISIN
SET-DAY	Settlement Tag (Intended settlement day)
SCHLUSSTAG	Schlusstag/Handelstag
UEB-G	Übertragungsgrund
EMPF-P2	Bei FoP WP-Überträgen muss die Teilnehmerinformation des endbegünstigten Kunden (KTO, ACC, BIC oder BLZ) eingetragen werden. Bei DvP WP-Überträgen ist keine Eingabe erforderlich. Falls zusätzliche Ebenen erforderlich sind, muss die Einzelerfassung genutzt werden.
NOMINALE	Nominalbetrag des Auftrags

Nach Datenfreigabe werden die eingegebenen Daten auf formale Richtigkeit und Plausibilität geprüft und ausgerichtet. Fehler werden angezeigt und müssen korrigiert werden. Erst wenn alle Daten korrekt sind, erscheint in Zeile 24 die Aufforderung, die Verarbeitung mit PF3 zu bestätigen. Jede Seite muss einzeln mit PF3 verarbeitet werden.

```
TRAN: KVEE FC: WM SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG       WP-UEBERTRAG / MEHRFACHERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS

PN: ____ LAST-KTO : 7930 ___ GUT-KTO: _____ ___   WKN: I DE0005752000 UEB-G: ___
EMISS-EINF(J/N): N  SCHLUSSTAG :             SET-DAY: 20.11.2014     OPT-OUT:
RTS-DVP   (J/N): N  REFERENZ-NR: _________________     PARTY-HOLD (J/N): N
EMPF-P1: ___________ ____________________________                WRG  : EUR
EMPF-P2:
TEXT   : ____________________________________________________________________

   AUFTNR LAST-KTO GUT-KTO  WKN                NOMINALE               GEGENWERT

     1234 7930 000 6789 000 DE0005752000            100                  234,67
       20 7930 000 5678 000 DE0005752000             23
       23 7930 000 4567 000 DE0005752000             12     ____________________









-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 08:27:55 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Die nach der Verarbeitung mit PF3 ausgegebene Mehrfacherfassungsmaske übernimmt die Vorbelegungen aus der Ersteinstiegsmaske.

Will man die Mehrfacherfassung beenden, kehrt man mit PF4 zum Menü Erfassung zurück.

4.1.4 Erfassung von Match-Instruktionen (MI)

Bei einem Wertpapierübertrag mit und ohne Gegenwert zwischen zwei Teilnehmern müssen aufgrund eines erforderlichen Matchings (vgl. Kapitel 4.5 Matching) beide Seiten (Lieferer/Verkäufer und Empfänger/Käufer der Wertpapiere) Eingaben in das System CASCADE vornehmen.

Die Match-Pflicht von Match-Aufträgen hängt einerseits ab von der Match-Pflicht des im Auftrag angegebenen Last- und Gut-Kontos und andererseits davon, ob es sich bei dem Wertpapierübertrag um eine Lieferung innerhalb eines Institutes (gleicher Kontostamm=4stellige Konto-Nummer) oder einem Wertpapierübertrag zwischen zwei unterschiedlichen Instituten (unterschiedliche Kontostämme) handelt.

1. Handelt es sich um einen Wertpapierübertrag ohne Gegenwert innerhalb desselben Institutes (gleicher CBF-Kontostamm), muss dieser nur dann gematcht werden, wenn beide daran beteiligten Konten matchpflichtig sind.
2. Handelt es sich um einen Wertpapierübertrag ohne Gegenwert zwischen zwei verschiedenen Instituten (unterschiedliche CBF-Kontostämme), muss dieser dann gematcht werden, wenn das darin angegebene GUT-Konto (Empfängerkonto der Wertpapiere) matchpflichtig ist.

4.1.4.1 Matchfreie CBF Konten

Für bestimmte CASCADE Kontogruppen ist die Matchpflicht von Wertpapierüberträge ohne Gegenwert grundsätzlich ausgeschlossen; das sind hauptsächlich Überträge von Sicherheiten z. B. Eurex Clearing AG, EEX oder Treuhandsperrkonten. Dasselbe gilt für die CBF-Konten 7399 000 und 7299 000 (beide lautend auf „Clearstream Banking“) bei der Emissionseinführung von CASCADE-RS Gattungen.

4.1.4.2 Matchpflichtige CBF-Konten

Die nachfolgende Tabelle gibt einen allgemeinen und beispielhaften Überblick über matchpflichtige CBF-Konten.

Kontenbezeichnung	Kontonummer[1)]
Kundenkonto	XXXX[1)] 000, XXXX 901-906, XXXX 061-062 (u. a.)
Kundenkonto / Makler	XXXX 000
Kundenkonto Vorratslager	XXXX 907
Nicht verkaufte Werte	XXXX 410
Eurex Bonds, Equity CCP	7525 000 und 8501 000 und weitere Konten z. B. zur Abwicklung von Buy-In-Ergebnissen
Kundenkonto Haussammelverwahrung	XXXX 001
Edelmetalle (Deutsche Börse Commodities GmbH)	7332 000
Eigenbestand	XXXX 097
Fremdbestand	XXXX 096
TEFRA D Leadmanager (nur Überträge an Dritte)	XXXX 670

[1)] CBF nutzt zur Bestimmung der Matchpflicht eines CBF-Kontos einen CBF-internen technischen Schlüssel. Da dieser nicht eindeutig den verschiedenen CBF-Kontonummern zugeordnet werden kann, sind in der Tabelle nur exemplarisch die häufigsten Ausprägungen genannt. Der Platzhalter „XXXX" entspricht dem vierstelligen CBF-Kontostamm.

Für Wertpapierüberträge gilt die Match-Pflicht auch für CBF-Konten zwischen Zentralen und deren Niederlassungen oder CBF-Kunden, die mehrere CBF-Kontostämme unterhalten, da hier verschiedene rechtliche Entitäten involviert sein können.

4.1.4.3 Basisdaten

4.1.4.3.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Während die Erfassung eines WP-Übertrages von der Verkäuferseite vorzunehmen ist, muss die Match-Instruktion von der Käuferseite eingegeben werden.

4.1.4.3.2 (B) Eingabemaske Match-Instruktion

```
TRAN: KVEE FC: MI SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        MATCH-INSTRUKTION / ERFASSUNG        ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: ____           AUFTNR: _________      VWA: GS

LAST     : ___________                                        /
GUT      : ___________                                        /
WKN      : I ____________

NOMINALE :    ___________________   EINHEIT:           DISPO-PRIORITAET: _
GEGENWERT:                          WRG    : EUR       PARTY-HOLD (J/N): N
DCA/REF  :                                             EMISS-EINF(J/N) : N

SET-DAY  : 20.11.2014               EX-TRD :           BATM/ADEA  (J/N): N
BOERSENPL: ____                     OPT-OUT:           RTS-DVP    (J/N): N

SCHLUSSTAG:                         REFERENZ-NR      :
KURS / WRG: ___________ ___         AUFTRAGS-REFERENZ:
SELBSTBES(J/N/ ):                   GEGEN-AUFTNR     :

-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79073FX -- 19/11/14 -- 12:33:19 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu
```

4.1.4.3.3 (C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung einer Match-Instruktion sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	vorbelegt mit:
AUFTNR	
VWA	„GS" = Girosammelverwahrung
LAST	
GUT	Bank-Nr. des erfassenden Kunden der CBF
WKN-KENNUNG	„I" (änderbar in "W")
WKN	
NOMINALE	
DISPO-PRIORITAET	„4 MST"
SET-DAY	nächster Bankarbeitstag
RTS-DVP	„N" = NEIN
EMISS-EINF	„N" = NEIN
PARTY HOLD	„N" = NEIN

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (Kapitel 2.3.7

Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen) gelten bei der Erfassung einer Match-Instruktion folgende Feldbesonderheiten:

PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld PRIMANOTE mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren inkl. der Aufträge für den Wertebereich.
DISPO-PRIORITAET	Folgende Ausprägungen sind möglich: 1 = für Batchverarbeitung - sehr hoch 2 = für Batchverarbeitung - hoch 3 = für Batchverarbeitung - mittel 4 = für Batchverarbeitung - Standard (= Vorbelegung) Vergleiche auch die ausführliche Beschreibung zu den Auswirkungen der einzelnen Dispositionsprioritäten und Settlementarten in Kapitel 0.
GEGENWERT	Das Feld GEGENWERT ist nur bei WP-Überträgen mit Gegenwert zu füllen.
WRG	Pflichtfeld bei Aufträgen mit Gegenwert. Zugelassene Fremdwährungen (z. B. USD, AUD, ...) sind entsprechend zu erfassen. Bei Gegenwertverrechnung in Schweizer Franken (CHF) und Einbeziehung eines Wertpapieres mit CH-ISIN ist die Beschreibung im CBF Customer Handbook (Kapitel 4.3) zu berücksichtigen.
DCA/REF	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
SET-DAY	Der SET-DAY kann auch in die Zukunft erfasst werden (außer bei Gegenwert EUR).
EX TRD	Die „Ex" Kennzeichnung für die Verarbeitung von Kompensationen kann hier eingegeben werden (J oder N); der Standardwert „leer" wird ohne Eingabe als "N" interpretiert.
BATM/ADEA	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
BOERSENPL	Der Börsenplatz ist zurzeit noch nicht nutzbar.
OPT-OUT	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
RTS-DVP	Folgende Ausprägungen sind möglich: J für RTS (Sofortdisposition) N für STD und SDS- Batchverarbeitung (Massendisposition) und Cont-SDS
SCHLUSSTAG	Der Tag, an dem die Endteilnehmer das WP-Geschäft/Börsengeschäft abgeschlossen haben (Trade-date)
AUFTRAGS-REFERENZ	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
GEGEN-AUFTNR	Bei matchpflichtigen Wertpapierüberträgen kann die eingebende Bank die CASCADE Auftragsnummer des Kontrahentenauftrags eingeben. Ein Direct Matching ist möglich bei Übereinstimmung der erforderlichen Match Kriterien.

4.1.4.3.4 (D) Eingabemaske Einzelerfassung-2

Sind die Mussfelder (vgl. Abschnitt C) ausgefüllt, so wechselt PF8 auf die zweite Seite der Eingabemaske.

```
TRAN: KVEE FC: MI SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG    MATCH-INSTRUKTION / ERFASSUNG-2          ERFASSUNGSSTATUS

                 PRIMANOTE:  123     AUFTNR:       354     WKN: I DE000A0Z17A1

UEB-GRUND   : ___


ALREADY MATCHED (J/ ):               PARTIAL SETTL.INDICATOR:
ISO TRANSACTION CODE :




TEXT: ____________________________________________________________________


-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79073FX -- 19/11/14 -- 13:55:44 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

4.1.4.3.5 (E) Feldbesonderheiten

PRIMANOTE / AUFTR / WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
ALREADY MATCHED	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
PARTIAL SETTL INDICATOR	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
ISO TRANSACTION CODE	Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.

4.1.4.3.6 (F) Abhängigkeitsprüfungen

EMISS-EINF

Wird bei einer Match-Instruktion das Feld Emissionseinführung auf „JA“ gesetzt und es handelt sich bei der eingegebenen WKN um eine Namensaktie, so gilt dann diese Angabe als optionales Matchkriterium.

SET-DAY

Nach 16:00 Uhr kann kein Auftrag mit RTS-DVP = J gegen EUR mit einer Valuta kleiner oder gleich dem Tagesdatum eingegeben werden.

4.1.4.4 Folgedaten

4.1.4.4.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Sollen hinsichtlich einer Match-Instruktion noch weitere Daten erfasst werden, so ist mit PF8 die Folgeerfassungsmaske aufzurufen.

4.1.4.4.2 (B) Folgemaske WP-Übertrag

```
TRAN: KVEE FC: MI SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG   MATCH-INSTRUKTION / SETL.PTY-ERFASSUNG    ERFASSUNGSSTATUS

                 PRIMANOTE:  123     AUFTNR:       354     WKN: I DE000A0Z17A1

SETTL PARTY - LIEFERER
P1: ___________ ____________________________________
P2: ___ ____________________________________________________________________________
P3: ___ ____________________________________________________________________________
P4: ___ ____________________________________________________________________________
P5:

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1:
P2: ___ ____________________________________________________________________________
P3:
P4:
P5: ___ ____________________________________________________________________________


-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79073FX -- 19/11/14 -- 14:11:18 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu  PF7:Zurück
```

Nach Datenfreigabe werden die eingegebenen Daten auf formale Richtigkeit und Plausibilität geprüft und ausgerichtet. Fehler werden angezeigt und müssen korrigiert werden. Erst wenn alle Daten korrekt sind, erscheint in Zeile 24 die Aufforderung, die Verarbeitung mit PF3 zu bestätigen. Jede Seite muss einzeln mit PF3 verarbeitet werden.

Im Unterschied zur Nutzung der Taste PF3 ermöglicht eine Nutzung der Taste PF6, dass die eingegebenen Daten nach der Verarbeitung weiterhin auf dem Bildschirm angezeigt werden und somit wieder verwendet werden können. Anschließend kann dann z. B. durch Überschreiben eines Feldes und erneutes Verarbeiten durch PF3 (oder PF6) ein weiterer Auftrag generiert werden.

4.1.4.4.3 (C) Feldbesonderheiten

PRIMANOTE / AUFTR / WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
SETTL PARTY - LIEFERER: P1 – P5	**Lieferer im Inland:** In P1 ist keine Eingabe möglich. Die Eingabe von P2 – P5 ist optional, erlaubt sind die Attribute KTO, ACC, BIC und BLZ. Für das Befüllen gibt es je nach gewähltem Level genaue Vorgaben zu Inhalt und Reihenfolge (siehe entsprechendes Eingabeschema). **Lieferer im Ausland:** P1 ist ein Pflichtfeld, wenn bei LAST-KTO die Kto-Nr. eines CSD bzw. ICSD (Kontengruppe 15; Lagerstelle Ausland) eingetragen wurde. In diesem Fall ist eine gültige Kontonummer/BIC bei dem CSD/ICSD in P1 zu erfassen. Details hierzu und mögliche weitere Pflichtangaben (P2 – P5) sind dem jeweiligen CASCADE Link Guide zu entnehmen. In Kombination mit eventuell gewünschten Angaben ist das passende Eingabeschema aus der entsprechenden Tabelle auszuwählen. Freie Felder können mit dem Attribut TXT für Freitext genutzt werden (z.B. Name und Adresse).
SETTL PARTY - EMPFAENGER: P1 – P5	**Empfänger im Inland:** In P1 ist keine Eingabe möglich. Die Eingabe von P2 – P5 ist optional, erlaubt sind die Attribute KTO, BIC und BLZ. Für das Befüllen gibt es je nach gewähltem Level genaue Vorgaben zu Inhalt und Reihenfolge (siehe entsprechendes Eingabeschema). **Empfänger im Ausland:** P1 ist ein Pflichtfeld, wenn bei GUT-KTO die Kto-Nr. eines CSD bzw. ICSD (Kontengruppe 15; Lagerstelle Ausland) eingetragen wurde. In diesem Fall ist eine gültige Kontonummer/BIC bei dem CSD/ICSD in P1 zu erfassen. Details hierzu und mögliche weitere Pflichtangaben (P2 – P5) sind dem jeweiligen CASCADE Link Guide zu entnehmen. In Kombination mit zusätzlich gewünschten Angaben ist das passende Eingabeschema aus der entsprechenden Tabelle auszuwählen. Freie Felder können mit dem Attribut TXT für Freitext genutzt werden (z.B. Name und Adresse).

Eingabeschema KVEE/MI: SETTL PARTY – LIEFERER (im Inland)					
	5 Level	4 Level	3 Level	2 Level	1 Level
P1 Konto	Last-Konto* (DEAG)				
P2	Auftraggebender Intermediär 1 (DEI1)	Auftraggebender Intermediär 1 (DEI1)	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)	
P3	Auftraggebender Intermediär 2 (DEI2)	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)		
P4	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)			
P5	Original-Auftraggeber (SELL)				

* wird aus der Grundmaske übernommen, falls zu dem entsprechenden Konto bereits ein SAC hinterlegt ist

Eingabeschema KVEE/MI: SETTL PARTY – LIEFERER (im Ausland)					
	5 Level	**4 Level**	**3 Level**	**2 Level**	**1 Level**
P1 BIC	BIC Auftrag-gebender Intermediär 1 (DEI1)	BIC Auftrag-gebender Intermediär 1 (DEI1)	BIC Auftrag-gebender Intermediär 1 (DEI1)	BIC Auftrag-gebende Depotbank (DECU)	BIC Original-Auftraggeber (SELL)
P1 Konto	Konto Auftrag-gebender Intermediär 1 (DEI1)	Konto Auftrag-gebender Intermediär 1 (DEI1)	Konto Auftrag-gebender Intermediär 1 (DEI1)	Konto Auftrag-gebende Depotbank (DECU)	Konto Original-Auftraggeber (SELL)
P2	Auftraggebender Intermediär 2 (DEI2)	Auftraggebender Intermediär 2 (DEI2)	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)	
P3	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)		
P4	(:70E::DECL/// DLP4)	Original-Auftraggeber (SELL)			
P5	Original-Auftraggeber (SELL)				

Eingabeschema KVEE/MI: SETTL PARTY – EMPFAENGER (im Inland)					
	5 Level	**4 Level**	**3 Level**	**2 Level**	**1 Level**
P1 Konto	Gut-Konto* (REAG)				
P2	Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)	
P3	Begünstigter Intermediär 2 (REI2)	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)		
P4	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)			
P5	Endbegünstigter (BUYR)				

* wird aus der Grundmaske übernommen, falls zu dem entsprechenden Konto bereits ein SAC hinterlegt ist

Eingabeschema KVEE/MI: SETTL PARTY – EMPFAENGER (im Ausland)					
	5 Level	4 Level	3 Level	2 Level	1 Level
P1 BIC	BIC Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	BIC Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	BIC Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	BIC Begünstigte Depotbank (RECU)	BIC Endbegünstigter (BUYR)
P1 Konto	Konto Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Konto Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Konto Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Konto Begünstigte Depotbank (RECU)	Konto Endbegünstigter (BUYR)
P2	Begünstigter Intermediär 2 (REI2)	Begünstigter Intermediär 2 (REI2)	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)	
P3	Begünstigte Depotbank (RECU)	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)		
P4	(:70E::DECL///RCP4)	Endbegünstigter (BUYR)			
P5	Endbegünstigter (BUYR)				

4.1.4.4.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

EMISS-EINF

Wird bei einer Match-Instruktion das Feld Emissionseinführung auf „JA“ gesetzt und es handelt sich bei der eingegebenen WKN um eine Namensaktie so gilt dann diese Angabe als optionales Matchkriterium.

SET-DAY

Nach 16:00 Uhr kann kein Auftrag mit RTS-DVP = J gegen EUR mit einer Valuta kleiner oder gleich dem Tagesdatum eingegeben werden.

4.1.5 Erfassung TEFRA D Freigabe (TD)

4.1.5.1 Basisdaten

4.1.5.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Gemäß der vom U.S. Internal Revenue Service erlassenen „Tax Equity and Fiscal Responsibility Act of 1982", kurz TEFRA D Regel, darf eine darunter fallende Wertpapieremission (kurz: TEFRA D Wertpapier oder TEFRA D Gattung) vom Emittenten oder seinen Vertriebspartnern innerhalb einer Frist von 40 Kalendertagen ab Begebung nicht an

- US-Bürger sowie
- Personen, die länger als 183 Tage in den USA leben und damit als US-Steuerinländer gelten,

verkauft werden. Dies ist von der jeweiligen depotführenden Bank im Rahmen der Geschäftstätigkeit für die bei CBF gehaltenen TEFRA D Wertpapiere zu prüfen und an CBF zu melden. CBF informiert nach Ablauf der Frist auf Basis dieser Meldungen das emissionsbegleitende Institut über den auf TEFRA D bezogenen Status der Investoren, damit die Nominale der endgültigen Globalurkundebestätigt werden kann.

Die CBF bietet zwei weitgehend automatisierte Verfahren zu Abwicklung von TEFRA D Wertpapieren innerhalb der Frist an, die den vormals papiergebundenen Prozess ersetzen. Beide Verfahren bilden die Regeln der US-amerikanischen Steuervorschriften in der erforderlichen Weise ab. Wegen der genauen Implikationen der TEFRA D Regelungen und der Wahl eines bestimmten Verfahrens wird der Kunde gebeten, seine steuerrechtlichen Berater zu konsultieren, da diese Beratung nicht im Service der CBF enthalten ist.

4.1.5.1.2 (B) Mögliche Verfahren

Verfahren mit instruktionsbezogenem Freigabe- und Zertifizierungsprozess („Striktes Verfahren")

Das sogenannte „Strikte Verfahren" ist von der CBF als Standard vorgesehen und umfasst einen instruktionsbezogenen Freigabe- und Zertifizierungsprozess. Nach jeder Gutschrift eines TEFRA D Wertpapiers innerhalb der 40tägigen Frist erfolgt eine automatische Umbuchung und damit Sperre der Wertpapiere auf das Unterkonto /671. Positionen auf diesem Unterkonto können über die CASCADE-Transaktion „KVEE TD" freigegeben werden. Freigaben sind bis einschließlich des dritten Bankarbeitstages nach Fristende möglich. Die Freigabe gilt rechtlich als Erklärung des Verfügenden, dass der CBF-Kunde bzw. dessen Kunde nicht US Tax Subject, d. h. Steuerinländer im Sinne der US-amerikanischen Steuervorschriften ist und daher keine TEFRA D Relevanz besteht.

Die weitere Verarbeitung wird durch das vom Empfänger für sein Depotkonto gewählte Verfahren bestimmt. Nimmt der Empfänger am „strikten Verfahren" teil, wird die Lieferung automatisch auf dessen TEFRA Unterkonto gebucht und muss damit erneut freigegeben werden. Sofern der Empfänger am nachfolgend beschriebenen „Flexiblen Verfahren" teilnimmt, verbleibt der Bestand auf dem Hauptkonto des Empfängers und unterliegt dessen zwingend vorzuhaltenden Prüfverfahren bezüglich der TEFRA D Regeln. In diesem Fall verlangt das System die Zertifizierung der Gesamtposition am Ende der 40tägigen Frist in der nachfolgend beschriebenen Weise.

Verfahren zur technischen Abbildung der Mindestanforderungen zu TEFRA D („Flexibles Verfahren")

Innerhalb der 40tägigen Frist für TEFRA D Wertpapiere erfolgt zunächst keine Sperre bzw. Umbuchung auf das Unterkonto /671 und folglich keine TEFRA D relevanten Erklärungen durch den Kontoinhaber bei CBF. Voraussetzung für die Teilnahme am „Flexiblen Verfahren" ist eine gegenüber der CBF abzugebende Selbstverpflichtung des Kontoinhabers, die Einhaltung der TEFRA D Regeln durch eigene Prüfverfahren zu überwachen. Am Ende der vorgenannten Sperrfrist wird der dann auf dem Hauptkonto verfügbare Bestand auf das Unterkonto gebucht und damit gesperrt. Danach ist eine Freigabe noch weitere drei Geschäftstage über die CASCADE-Transaktion „KVEE TD" möglich. Die Freigabe-Instruktionen können auch vor der automatischen Sperre, d. h. der Umbuchung auf Unterkonto /671, mit zukünftiger Valuta erfasst werden. Bestandsbezogene Vorabinformationen in TEFRA D Gattungen, für die die 40tägige Frist ab Begebung läuft, werden zum 20., 30. Und geschäftstäglich vom 36. bis 39. Tag der Frist in Form von Listen versendet. Die Teilnahme am „Flexiblen Verfahren" muss mit einem separaten Formular bei der CBF beantragt werden (verfügbar über Client Services Frankfurt).

4.1.5.1.3 (C) Prozessbeschreibung

Durch eine TEFRA D Freigabe über die CASCADE Transaktion „KVEE TD“ erfolgt eine Umbuchung per Sperrdepot zu Gunsten des angegebenen Abwicklungskontos (in der Regel des Hauptkontos xxxx/000). Die Freigabe gilt als Erklärung des verfügenden CBF-Kunden, dass der übertragene Bestand nicht für im Sinne der TEFRA D Regeln dazu Nichtberechtigten gehalten wurde. Sollte ein Teil des gesperrten Bestandes zu Gunsten einer nicht berechtigten Person gebucht sein, so hat dieser Teilbestand auf dem Sperrdepot zu verbleiben. Die Verpflichtung zur Prüfung der Ordnungsmäßigkeit der Freigabe liegt beim bestandsführenden CBF-Kunden.

Gemäß der TEFRA D Regeln dauert die Sperrfrist, wenn vom Emittenten nicht anders verfügt wird, 40 Tage ab Begebung. Die CBF bietet eine Frist von nochmals drei Geschäftstagen zur systemgestützten Abgabe der erforderlichen bestand bezogenen Erklärungen nach TEFRA D an. Das Einräumen dieser zusätzlichen Frist befindet sich im Einklang mit der US-amerikanischen Steuergesetzgebung. Am Ende des 43. Tages informiert die CBF das emissionsbegleitende Institut gemäß den Anforderungen der TEFRA D Regeln über die Bestände der Gattung in ihrem System. Wenn zu diesem Zeitpunkt noch Bestände auf Sperrdepots von CBF-Kunden liegen, gilt dies als Erklärung des Kontoinhabers, dass diese Positionen von im Sinne der TEFRA D Regeln nicht Berechtigten gehalten werden. Das trifft sowohl auf das „Strikte Verfahren“ wie auf das „Flexible Verfahren“ zu.

Das emissionsbegleitende Institut ist für die Information des von ihm betreuten Emittenten des jeweiligen TEFRA D Wertpapiers verantwortlich, da die CBF im Regelfall keine direkte Geschäftsbeziehung zum Emittenten unterhält.

Nach der von CBF vorgenommenen Meldung an das emissionsbegleitende Institut liegt die weitere Bearbeitung der Gattung gemäß der TEFRA D Regeln bei diesem. Daher kann eine Freigabe drei Bankarbeitstage nach Ablauf der Frist seitens des bestandsführenden Kunden nur noch mit Zustimmung des emissionsbegleitenden Instituts erfolgen. Dies erfolgt systemseitig durch den vom Kunden zu veranlassenden Übertrag des freizugebenden Bestandes über dessen Sperrdepot auf das Sonderdepot (yyyy/670) des emissionsbegleitenden Instituts. Nach der Zustimmung des Emittenten entsperrt das emissionsbegleitende Institut den Bestand und überträgt den freigegebenen Anteil auf das Hauptkonto des betreffenden Kunden.

Erträgnis- und Rückzahlungen werden auf gesperrte Bestände im Sperrdepot xxxx/671 nicht vorgenommen.

4.1.5.1.4 (D) Eingabemaske TEFRA D Freigabe

```
TRAN: KVEE FC: TD SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / TEFRA-D FREIGABE      ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: ____           AUFTNR: _________      VWA: GS         TR: _

LAST     : ___________                                        /
GUT      : ___________                                        /
WKN      : I ____________

NOMINALE :    ___________________   EINHEIT:           DISPO-PRIORITAET: 4 MST
GEGENWERT:                         WRG    : EUR       PARTY-HOLD (J/N): N
DCA/REF  :                                            EMISS-EINF (J/N): N

SET-DAY  : 20.11.2014              EX-TRD :           BATM/ADEA  (J/N): N
BOERSENPL: ____                    OPT-OUT:           RTS-DVP    (J/N): N

SCHLUSSTAG:                        REFERENZ-NR      :
KURS / WRG: ___________ ___        AUFTRAGS-REFERENZ:
                                   GEGEN-AUFTNR     :

-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79073FX -- 19/11/14 -- 10:43:41 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

4.1.5.1.5 (E) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung einer TEFRA D Freigabe sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	vorbelegt mit:
AUFTNR	
VWA	„GS" = Girosammelverwahrung
LAST	Unterkonto /671 der Bank-Nr. des erfassenden Kunden der CBF
GUT	Leer / Unterkonto des emissionsbegleitenden Instituts /670 nach Ende der 40 Tage Frist (TEFRA D Frist)
WKN-KENNUNG	"I" (änderbar in "W")
WKN	
NOMINALE	
DISPO-PRIORITAET	"4 MST"
SET-DAY	nächster Bankarbeitstag
RTS-DVP	"N" = NEIN
EMISS-EINF	"N" = NEIN
PARTY HOLD	"N" = NEIN

Ansonsten gelten die Feldbeschreibungen für die Einzelerfassung eines WP-Übertrages (siehe Kapitel 4.1) auch für TEFRA D Freigaben.

4.1.5.1.6 (E) Eingabemaske TEFRA D Freigabe/Erfassung-2

Sind die Mussfelder (vgl. Abschnitt D) ausgefüllt, so wechselt PF8 auf die zweite Seite der Eingabemaske:

```
TRAN: KVEE FC: TD SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG-2          ERFASSUNGSSTATUS

                  PRIMANOTE:  123     AUFTNR:    456789     WKN: I DE000A1KXXR3

UEB-GRUND  : ___

EXT SET-DAY: __________              RUECKUEBERTRAG (J/N)    : N
ALREADY MATCHED (J/ ):               PARTIAL SETTL.INDICATOR:
ISO TRANSACTION CODE :

BELEGSCHAFT-SP: N                    SP-DATUM: __________
KUPONINFO/RECORD-DATE:




TEXT:


-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79073FX -- 19/11/14 -- 11:17:01 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

4.1.5.1.7 (F) Abhängigkeitsprüfungen

Die Prüfungen werden wir für die Einzelerfassung eines WP-Übertrages durchgeführt mit folgenden Besonderheiten:

LAST

LAST wird mit dem TEFRA D Sperrdepot (xxxx/671) des erfassenden Kunden vorbelegt.

GUT

GUT wird nur nach Ablauf der TEFRA D Frist (40 Tage) mit der speziellen Unterkontonummer des emissionsbegleitenden Instituts (xxxx/670) vorbelegt; innerhalb der Frist wird GUT nicht vorbelegt.

4.1.5.2 Folgedaten

Für die Folgedaten gelten die allgemeingültigen Feldbeschreibungen für die Einzelerfassung eines WP-Übertrages (siehe oben) auch für TEFRA D Freigaben.

4.1.5.2.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Befindet sich der Kontrahent des WP-Übertrages im Ausland oder wird ein Auftrag frei von Zahlung erfasst, so *müssen* zusätzliche Daten in einer Folgemaske eingegeben werden.

4.1.5.2.2 (B) Folgemaske TEFRA D Freigabe

```
TRAN: KVEE FC: TD SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / SETL.PTY-ERFASSUNG    ERFASSUNGSSTATUS

                 PRIMANOTE:  123     AUFTNR:    456789     WKN: I DE000A1KXXR3

SETTL PARTY - LIEFERER
P1:
P2: ___ ____________________________________________________________________
P3:
P4:
P5: ___ ____________________________________________________________________

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1: ___________  ___________________________________
P2:
P3: ___ ____________________________________________________________________
P4: ___ ____________________________________________________________________
P5:


-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79073FX -- 19/11/14 -- 11:21:15 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

4.1.5.2.3 (C) Feldbesonderheiten

Es gelten dieselben Feldbeschreibungen wie für die Einzelerfassung eines WP-Übertrages (siehe Kapitel 4.1).

Freigabe und Lieferung von TEFRA D Wertpapieren (für beide Verfahren)

Abhängig vom jeweiligen Prozessschritt bestehen verschiedene Möglichkeiten der Freigabe von Lieferungen oder Verkaufsinstruktionen von TEFRA D Wertpapieren in und nach der 40tägigen Frist:

1. Die TEFRA D Wertpapiere sind bereits vom verfügenden CBF-Kunden (Striktes Verfahren) freigegeben worden oder das empfangende Konto nimmt am „Flexiblen Verfahren" teil, die TEFRA D Gattung befindet sich nicht auf dem Sperrdepot xxxx/671:
   Die Wertpapiere können per Wertpapierübertrag (WPÜ) ohne Gegenwert instruiert werden. Die weitere Verarbeitung beim empfangenden CBF-Kunden hängt vom Set up des Empfängerkontos ab.
2. Die TEFRA D Wertpapiere werden innerhalb der 40tägigen Frist auf dem Sperrdepot xxxx/671 als Bestand geführt:

   Die Wertpapiere können über die Freigabefunktion in CASCADE (KVEE TD) und CASCADE-PC zu Gunsten des Abwicklungskontos (in der Regel das Hauptkonto) umgebucht werden, sofern dies nach Prüfung des Kunden den TEFRA D Regeln entspricht.
3. Die TEFRA D Wertpapiere befinden sich nach Ablauf der 40tägigen Frist noch auf dem Sperrdepot xxxx/671:

   Eine Freigabe nach Ablauf der Laufzeit und weiteren drei Bankarbeitstagen kann nur noch nach Zustimmung des emissionsbegleitenden Instituts erfolgen. Daher wird systemseitig nur die Umbuchung auf das Unterkonto /670 des emissionsbegleitenden Instituts zugelassen. Diese Umbuchung erfolgt über die TEFRA D Freigabefunktion (KVEE TD); nach Eingabe der ISIN oder Wertpapierkennnummer wird das Sonderkonto des emissionsbegleitenden Instituts als GUT-Konto vorgegeben. Bei der Eingabe einer anderen Kontonummer wird durch eine Fehlermeldung auf diesen Sachverhalt hingewiesen. Nach der Löschung der fehlerhaften Kontonummer und nochmaliger Freigabe wird das korrekte Sonderkonto des emissionsbegleitenden Instituts eingeblendet. Das emissionsbegleitende Institut nimmt nach Zustimmung des Emittenten den Umtausch in den freigegebenen Bestand vor und überträgt den Anteil auf das Hauptkonto des betreffenden Kunden.
4. Nach Ablauf der 40-tägigen Frist können die TEFRA D Wertpapiere als regulärer Wertpapierübertrag (WPÜ) mit und ohne Gegenwert erfasst werden. Eine Umbuchung auf ein Sperrdepot erfolgt danach nicht mehr.

4.1.6 Einzelerfassung von BWV-Überträgen (BE)

4.1.6.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Nach Eingabe des Funktionscodes „BE“ in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung zur Verfügung gestellt.

WP-Überträge in Einzelschuldbuchforderung sind WP-Überträge einer Bank (Teilnehmer CBF) an die Deutsche Finanzagentur, um einen Anteil aus der Sammelschuldbuchforderung, lautend auf die Clearstream Banking AG, Frankfurt, in eine Einzelschuldbuchforderung zugunsten eines Einzelschuldbuchgläubigers umzuwandeln. Auftraggeber dieser Übertragungsart ist der Teilnehmer der CBF, Empfänger ist die Deutsche Finanzagentur.

4.1.6.1.2 (B) Eingabemaske Einzelerfassung

```
TRAN: KVEE FC: BE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        BSV-UEBERTRAG / EINZELERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE:              UEBERTRAG-ART: 1 AN SV   AUFTNR:           VWA: GS

LAST     : ___________                                          /
GUT      :                                                      /
WKN      : I ____________

NOMINALE :                                        EINHEIT:
SET-DAY  : 20.11.2014                             DISPO-PRIORITAET: 4 MST
KUPONINFO: __________   ST-ZINS: __________  EUR  ERWERBS-TAG  : __________
ERWORBEN/VERW. (J/N):                  ERWERBS-PREIS:                    EUR
SV-KTO : __________                    PERSON   : _
NAME1  :                               VORNAME1:
NAME2  :                               VORNAME2:
STRASSE: ______________________________
LKZ    : D                             PLZ/ORT :
TEXT   : ____________________________________________________________________

-- ID-KZ: 7930220003 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 08:41:59 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

4.1.6.1.3 (C) Feldbesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines BWV-Übertrages sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	vorbelegt mit:
UEBERTRAG-ART	"1"
AUFTNR	
VWA	"GS" = Girosammelverwahrung
LAST	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
GUT	SV-Konto der Deutsche Finanzagentur (7950)
WKN	"I" änderbar in "W"
NOMINALE	
SET-DAY	nächster Bankarbeitstag
DISPO-PRIORITAET	"4 MST"
St-ZINS	EUR
SV-KONTO	
PERSON	***
NAME1	
VORNAME1	
STRASSE	
LKZ	"D" = Deutschland
PLZ/ORT	

*** muss nur gefüllt werden, wenn im Feld SV-KONTO „Neueintrag" eingegeben wurde

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (vgl. Kapitel 2.3.7

Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen) gelten bei der Einzelerfassung eines BWV-Übertrages folgende Feldbesonderheiten:

PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld PRIMANOTE mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
UEBERTRAG-ART	Nur „1" für Übertragung an die Deutsche Finanzagentur zulässig.
VWA	Nur „GS" für Girosammelverwahrung möglich.
LAST	Nur inländisches Konto erlaubt. Darüber hinaus ist für das LAST-KTO nur Konto-Art 1 (Kundenkonto), 10 (Kundenkonto) oder 14 (Verfügungskonto) zulässig.
GUT-	Es darf nur ein BWV-Konto (Kontoart 7) eingegeben werden.
DISPO-PRIORITAET ***	Folgende Ausprägungen sind möglich: 1 = für Batchverarbeitung (Massendisposition) - sehr hoch 2 = für Batchverarbeitung - hoch 3 = für Batchverarbeitung - mittel 4 = für Batchverarbeitung - Standard (= Vorbelegung)
KUPON-INFO	Dies Feld ist als freies Feld definiert und hat damit keine Auswirkungen auf die Zinsverrechnung.
ST-ZINS	Aufgrund der Zinsabschlagssteuer müssen auch bei Übertragungen an die Deutsche Finanzagentur die gezahlten Stückzinsen mitangegeben werden.
ERWERBS-PREIS	In diesem Feld ist der steuerlich relevante Aufwand für den Erwerb der WKN anzugeben, d. h. der reine Nettokaufpreis ohne Provisionen und Gebühren. Aufgewandte Stückzinsen sind in diesem Preis nicht zu berücksichtigen. Sie werden im separaten Feld ST-ZINS (vgl. dort) angegeben. Ab November 2001 ist EUR möglich. Bei nachfolgenden Wertpapierarten muss dieses Feld gefüllt werden: Bundesschatzbriefe Typ A und Typ B nach dem 1. Januar 1994 begebene zinsvariable oder Strip-fähigen Anleihen
ST-ZINS	Aufgrund der Zinsabschlagssteuer müssen auch bei Übertragungen an die Landesschuldenverwaltung die gezahlten Stückzinsen mitangegeben werden.
SV-KONTO	Hier ist stets die 7-stellige Schuldbuch-Kontonummer einzugeben, die mit 0, 1, 3, 4, 6, 8 oder 9 beginnen muss (6-stelligen Kontonummern ist die "0" voranzustellen). Sofern für den Begünstigten noch kein Schuldbuchkonto besteht, ist "NEUEINTRAG" in das Feld einzugeben. Das Feld PERSON ist dann ein Mussfeld.
NAME 1 / VORNAME 1	Hier sind Name und Vorname des Schuldbuchkonto-Inhabers, bei Neueintragungen Name und Vorname des Begünstigten einzutragen. Namenszusätze und Berufsbezeichnungen sind nicht einzugeben. Vorsatzwörter wie „von" sind hinter dem Vornamen möglich. Beispiel: Peter von Müller ist im Feld „NAME" mit „Müller" und im Feld „VORNAME" mit „Peter von" zu erfassen. Entsprechendes gilt für akademische Grade (z. B. Prof., Dr., Dipl.-Ing.) und für historisch bedingte Namenszusätze (Baron, Freiherr, Graf). Bei bereits bestehenden Schuldbuchkonten ist die Angabe akademischer Grade und historisch bedingter Namenszusätze nicht

	erforderlich. Ansonsten gelten für die Schreibweise von Namen die Regeln der DIN-Norm 5007 in ihrer jeweils gültigen Fassung.
NAME 2 / VORNAME 2	Bei Gemeinschaftskonten sind hier Name und Vorname des 2. Kontoinhabers einzutragen. Bei Neueintragungen kann - wenn gewünscht - ein zweiter Begünstigter eingegeben werden.
STRASSE / PLZ / ORT	Weichen bei Neueintragungen für zwei Begünstigte die Anschriften voneinander ab, sind hier die Angaben zum ersten Begünstigten einzugeben.
LKZ	Zulässig sind die im Anhang in der entsprechenden Tabelle angegebenen Länderkurzbezeichnungen. Enthält die Liste für das Land des Begünstigten keine Kurzbezeichnung, ist „XXX" einzutragen.

4.1.6.1.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST / GUT

Lastschrift-Konto und Gutschrift-Konto dürfen nicht gleich sein.

LAST / USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.

GUT / WKN

Bei Überträgen an die BWV (GUT = BWV-Konto) sind im Feld WKN nur folgende Wertpapierarten erlaubt:

- Anleihen des Bundes und seiner Sondervermögen
- Anleihen der Deutschen Ausgleichsbank
- Schatzanweisungen (Kassenobligationen) des Bundes und seiner Sondervermögen
- Bundesschatzbriefe
- Bundesobligationen
- Finanzierungsschätze

Voraussetzung: Für das zu erfassende Wertpapier muss die „Umwandlung in Einzelschuldbuchforderung" möglich sein.

SV-KONTO / PERSON

Wurde das SV-KONTO mit der Bezeichnung „NEUEINTRAG" gefüllt, so muss im Feld PERSON angegeben werden, ob sich die Eingaben auf

eine natürliche Person (Feldeingabe: „P" für persönlich) oder

eine juristische Person (Feldeingabe: „U" für unpersönlich)

beziehen. Darüber hinaus ist vom Begünstigten ein Antrag auf Eröffnung eines Schuldbuchkontos bei der Deutsche Finanzagentur zu stellen.

PERSON / VORNAME 1

Wurde das Feld PERSON mit „U" für unpersönlich gefüllt, dann ist im Feld VORNAME1 (= Mussfeld) ein „X" einzugeben.

ERWERBSTAG / ST-ZINS

Wird das Feld ST-ZINS gefüllt, so muss auch das Feld ERWERBSTAG gefüllt werden.

ERW-PREIS / ERWERBSTAG

Wird das Feld ERW-PREIS gefüllt, so sind auch Eintragungen im Feld ERWERBSTAG erforderlich.
Wird das Feld ERW-PREIS gefüllt, so muss auch die Währungsangabe gefüllt sein (EUR)

4.1.7 Erfassung von LSV-Überträgen (LE)

4.1.7.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Nach Eingabe des Funktionscodes „LE" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung zur Verfügung gestellt.

Bei Überträgen an eine Landesschuldenverwaltung wird ein Anteil aus der Sammelschuldbuchforderung, lautend auf die Clearstream Banking AG, Frankfurt, in eine Einzelschuldbuchforderung zugunsten eines Einzelschuldbuchgläubigers umgewandelt. Auftraggeber dieser Übertragungsart ist der Kunde der CBF, Empfänger ist eine Landesschuldenverwaltung.

Es können nur solche Wertpapiere übertragen werden, bei denen ausdrücklich eine Umwandlung in eine Einzelschuldbuchforderung möglich ist.

4.1.7.1.2 (B) Eingabemaske Einzelerfassung LSV-Übertrag

```
TRAN: KVEE FC: LE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        LSV-UEBERTRAG / EINZELERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: ____          UEBERTRAG-ART: 1 AN  SV  AUFTNR: _________ VWA: GS

LAST     : ___________                                        /
GUT      : ___________                                        /
WKN      : I

NOMINALE  : ____________________                      EINHEIT:
SET-DAY   : 20.11.2014                                DISPO-PRIORITAET: 4 MST
KUPONINFO : __________  ST-ZINS: __________  EUR  ERWERBS-TAG  : __________
ERWORBEN/VERW. (J/N): _                    ERWERBS-PREIS: _________________  EUR
SV-KTO :                                   PERSON  :
NAME1  : ______________________________    VORNAME1: ______________________________
NAME2  :                                   VORNAME2:
STRASSE:
LKZ    : D                                 PLZ/ORT : _____ ________________________
TEXT   :

-- ID-KZ: 7930220003 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 08:44:40 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

4.1.7.1.3 (C) Feldbesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines LSV-Übertrages sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	vorbelegt mit:
UEBERTRAG-ART	"1"
AUFTNR	
VWA	"GS" = Girosammelverwahrung
LAST	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
GUT	
WKN	"I" änderbar in "W"
NOMINALE	
SET-DAY	nächster Bankarbeitstag
DISPO-PRIORITAET	"4 MST"
SV-KONTO	
PERSON	***
NAME1	
VORNAME1	
STRASSE	
LKZ	"D" = Deutschland
PLZ/ORT	

*** muss nur gefüllt werden, wenn im Feld SV-KONTO „Neueintrag" eingegeben wurde.

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (vgl. Kapitel 2.3.7

Allgemeingültige Feldbeschreibungen **und Formalprüfungen**) gelten bei der Einzelerfassung eines LSV-Übertrages folgende Feldbesonderheiten:

PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld PRIMANOTE mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
ÜEBERTRAG-ART	Nur „1" für Übertragung an die Landesschuldenverwaltung zulässig.
VWA	Nur „GS" für Girosammelverwahrung zulässig.
LAST	Nur inländisches Konto erlaubt. Darüber hinaus ist für das LAST-KTO nur Konto-Art 1 (Kundenkonto), 10 (Kundenkonto) oder 14 (Verfügungskonto) zulässig.
GUT	Es darf nur ein LSV-Konto (Kontoart 8) eingegeben werden.
DISPO-PRIORITAET	Folgende Ausprägungen sind möglich: 1 = für Batchverarbeitung (Massendisposition) - sehr hoch 2 = für Batchverarbeitung - hoch 3 = für Batchverarbeitung - mittel 4 = für Batchverarbeitung - Standard (= Vorbelegung)
KUPON-INFO	Dies Feld ist als freies Feld definiert und hat damit keine Auswirkungen auf die Zinsverrechnung.
ST-ZINS	Aufgrund der Zinsabschlagssteuer müssen auch bei Übertragungen an die Landesschuldenverwaltung die gezahlten Stückzinsen mitangegeben werden.
ERWERBS-TAG	Als Erwerbstag ist der Abrechnungstag anzugeben. (vgl. Mitteilung des Bundesministeriums für Finanzen --> IV B4 - S2400 -136 vom 25. Oktober 1994). Das Feld ermöglicht der Deutsche Finanzagentur im Rahmen der steuerlichen Behandlung des Zinsabschlages die korrekte Zuordnung von gemeldeten Stückzinsen zum jeweiligen Kalenderjahr vorzunehmen.
ERWORBEN/VERW.	Das übertragende Institut hat hier eine Eintragung bezüglich des Erwerbs und der Verwahrung der Wertpapiere vorzunehmen: J = JA: Das übertragende Institut hat die Wertpapiere für den Kunden am Markt erworben oder aus ihrem Eigenbestand veräußert und seitdem verwahrt und verwaltet. N = NEIN: Das übertragende Institut hat die Wertpapiere bspw. aus einem Depotübertrag des Kunden erhalten.
ERWERBS-PREIS	In diesem Feld ist der steuerlich relevante Aufwand für den Erwerb der Wertrechte anzugeben, d. h. der reine Nettokaufpreis ohne Provisionen und Gebühren. Aufgewandte Stückzinsen sind in diesem Preis nicht zu berücksichtigen. Sie werden im separaten Feld ST-ZINS (vgl. dort) angegeben. Bei nachfolgenden Wertpapierarten muss dieses Feld gefüllt werden: Bundesschatzbriefe Typ A und Typ B und nach dem 1.Januar 1994 begebene zinsvariable Anleihen oder Stripped Bonds.
SV-KONTO	Hier ist stets die Landesschuldbuch-Kontonummer einzutragen. Sofern für den Begünstigten noch kein Schuldbuchkonto besteht, ist „NEUEINTRAG" in das Feld einzugeben. Das Feld PERSON ist dann ein Mussfeld.
NAME 1/ VORNAME 1	Hier sind Name und Vorname des Schuldbuchkonto-Inhabers, bei Neueintragungen Name und Vorname des Begünstigten einzutragen.

	Namenszusätze und Berufsbezeichnungen sind nicht einzugeben. Vorsatzwörter wie „von" sind hinter dem Vornamen möglich. Beispiel: Peter von Müller ist im Feld „NAME" mit „Müller" und im Feld „VORNAME" mit „Peter von" zu erfassen. Entsprechendes gilt für akademische Grade (z. B. Prof., Dr., Dipl.-Ing.) und für historisch bedingte Namenszusätze (Baron, Freiherr, Graf). Bei bereits bestehenden Schuldbuchkonten ist die Angabe akademischer Grade und historisch bedingter Namenszusätze nicht erforderlich. Ansonsten gelten für die Schreibweise von Namen die Regeln der DIN-Norm 5007 in ihrer jeweils gültigen Fassung.
NAME 2 / VORNAME 2	Bei Gemeinschaftskonten sind hier Name und Vorname des 2. Kontoinhabers einzutragen. Bei Neueintragungen kann - wenn gewünscht - ein zweiter Begünstigter eingegeben werden.
STRASSE / PLZ / ORT	Weichen bei Neueintragungen für zwei Begünstigte die Anschriften voneinander ab, sind hier die Angaben zum ersten Begünstigten einzugeben.
LKZ	Zulässig sind die im Anhang in der entsprechenden Tabelle angegebenen Länderkurzbezeichnungen. Enthält die Liste für das Land des Begünstigten keine Kurzbezeichnung, ist „XXX" einzutragen.

4.1.7.1.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST / GUT

Lastschrift-Konto und Gutschrift-Konto dürfen nicht gleich sein.

LAST / USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.

GUT / WKN

Bei Überträgen an die LSV (GUT = LSV-Konto) sind im Feld WKN nur Länderanleihen erlaubt.

Grundsätzlich müssen für diese Anleihen Eintragungen in das Landesschuldbuch möglich sein.

SV-KONTO/PERSON

Wurde das SV-KONTO mit der Bezeichnung „NEUEINTRAG" gefüllt, so muss im Feld PERSON angegeben werden, ob sich die Eingaben auf

- eine natürliche Person (Feldeingabe: „P" für persönlich) oder
- eine juristische Person (Feldeingabe: „U" für unpersönlich)

beziehen. Darüber hinaus ist vom Begünstigten ein Antrag auf Eröffnung eines Schuldbuchkontos bei der Landesschuldenverwaltung zu stellen.

ERWERBSTAG / ST-ZINS

Wird das Feld ST-ZINS gefüllt, so müssen auch die Felder ERWERBSTAG und die Währungsbezeichnung gefüllt werden.

ERW-PREIS / ERWERBSTAG

Wird das Feld ERW-PREIS gefüllt, so sind auch Eintragungen in den Feldern ERWERBSTAG und die Währungsbezeichnung erforderlich.

4.1.8 Erfassung Umtausch GBC (UT)

4.1.8.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Auftragsart Umtausch Global Bearer Certificates (GBC) wird der Tausch von bestimmten Aktien bei der entsprechenden Lagerstelle der CBF in Anteile an dem Inhabersammelzertifikat der CBF vorgenommen.

Der gültig erteilte Umtauschauftrag wird automatisch gesperrt und erst zur Disposition und Buchung übernommen, wenn die Stücke bei der Lagerstelle der CBF eingegangen sind. Die Freigabe der Aufträge erfolgt nur durch die CBF. Direkt anschließend finden Disposition und Buchung im RTS statt.

Nach Eingabe des Funktionscodes „UT" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

Detaillierte Beschreibungen finden Sie auch auf unserer Website unter
http://www.clearstream.com/clearstream-en/products-and-services/settlement/settlement-services/csd-gbc-conversions/global-bearer-certificates/11384

4.1.8.1.2 (B) Eingabemaske Umtausch GBC

```
TRAN: KVEE FC: UT SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        UMTAUSCH / ERFASSUNG                 ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE:                AUFTNR:                                      VWA:

LAST     : 7961 000       CBF TRESORBESTAND SVG               / DAKVDEFFXXX
GUT      :                                                    /
WKN      : I ____________

NOMINALE :                          EINHEIT:         ST-ART:

TRADE-DATE:                         EXT.SET-DAY:
CBF-LAG   :

KUNDENREFERENZ:     -                 -

LIEFERUNG-VON NAME: ____________________________________
TEXT:


-- ID-KZ: 7999000099 -- PW:          ------ B79074E4 -- 19/11/14 -- 15:57:05 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

4.1.8.1.3 (C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung eines Umtausches sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	vorbelegt mit:
AUFTNR	
GUT	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
WKN-KENNUNG	"I" änderbar in "W"
WKN	
NOMINALE	
TRADE-DATE	
LIEFERUNG-VON NAME	**Verschlüsselung der ISIN in WSS mit LGL/LGS 271/001** Die Instruktionseingabe muss mit dem Wert „CRST/" eingegeben werden. Bei fehlerhafter Eingabe wird folgende Fehlermeldung angezeigt: KV0779F Nur Eingaben mit „CRST/" erlaubt. Danach ist nur noch die Eingabe von bis zu 5 Stellen (alphanumerisch) möglich. Alle anderen Angaben werden je nach erfasster ISIN mit einer Fehlermeldung abgelehnt. **Verschlüsselung der ISIN in WSS ohne LGL/LGS 271/001** Die Instruktionseingabe bezieht sich ebenfalls auf Global Bearer Certificates. Die Instruktionseingabe muss ohne den Wert „CRST/" eingegeben werden. Stattdessen wird das Feld „LIEFERUNG-VON NAME" geprüft. Das entsprechende Feld „LIEFERUNG-VON NAME" muss den Wert „BIC/" und den dazugehörenden 8stelligen BIC aufweisen. Es wird geprüft, dass die ersten 6 Stellen nur Großbuchstaben und die letzten 2 Stellen Großbuchstaben oder Zahlen enthalten. Alle anderen Angaben werden mit Fehlerhinweis "FÜR DIESE ISIN NUR BIC DES KONTRAHENTEN MÖGLICH" abgelehnt.

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (vgl. Kapitel „Hinweise" Abschnitt 7) gelten bei der Erfassung eines Umtauschauftrages folgende Feldbesonderheiten:

AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
VWA	Die Verwahrart wird nach Eingabe der jeweiligen WKN automatisch vom System zugesteuert.
LAST	Das Last-Konto wird automatisch mit dem Tresorkonto der CBF vorbelegt und ist nicht veränderbar.
GUT	Das Gut-Konto muss nachfolgender Kontoart entsprechen: - Kundenkonten
WKN	Die eingegebene WKN muss die entsprechende Verwahrmöglichkeit ausweisen.
CBF-LAG	Ergibt sich aus der WKN und ist nicht änderbar.
LIEFERUNG-VON NAME	Siehe oben

4.1.8.1.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST / GUT

Last-Konto und Gut-Konto dürfen nicht gleich sein.

GUT / USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.

4.1.9 Erfassung Rücktausch GBC (RT)

4.1.9.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Auftragsart Rücktausch Global Bearer Certificates (GBC) werden Anteile an dem Inhabersammelzertifikat der CBF in bestimmte Aktien bei der entsprechenden Lagerstelle der CBF in im betreffenden Land lieferbare Originalaktien getauscht.

Die Disposition und Buchung erfolgt an dem vom Eingeber vorgegebenen Settlement-Day.

Nach Eingabe des Funktionscodes „RT" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

Detaillierte Beschreibungen finden Sie auch auf unserer Website unter
http://www.clearstream.com/clearstream-en/products-and-services/settlement/settlement-services/csd-gbc-conversions/global-bearer-certificates/11384

4.1.9.1.2 (B) Eingabemaske Rücktausch GBC

```
TRAN: KVEE FC: RT SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        RUECKTAUSCH / ERFASSUNG              ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: ____           AUFTNR: _________                          VWA:
LAST     :                                                  /
GUT      : 7961000        CBF TRESORBESTAND SVG              / DAKVDEFFXXX
WKN      : I ____________

NOMINALE : ___________________     EINHEIT:         ST-ART:
SET-DAY  : 20.11.2014
TRADE-DATE:                        EXT.SET-DAY:
CBF-LAG   :

KUNDENREFERENZ:     -                 -
LIEFERUNG-AN NAME : ____________________________________
ADRESSE:
BEGUENSTIGTER NAME: ____________________________________
ADRESSE: ____________________________________________________________________
TEXT   :

-- ID-KZ: 7930220003 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 08:48:05 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

4.1.9.1.3 (C) Feldbesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines Rücktausches sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	vorbelegt mit:
AUFTNR	
LAST	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
WKN-KENNUNG	"I" änderbar in "W"
WKN	
NOMINALE	
SET-DAY	nächster Bankarbeitstag
TRADE-DATE	
LIEFERUNG-AN NAME	**Verschlüsselung der ISIN in WSS mit LGL/LGS 271/001** Die Instruktionseingabe muss mit dem Wert „CRST/" eingegeben werden. Bei fehlerhafter Eingabe wird folgende Fehlermeldung angezeigt: KV0779F Nur Eingaben mit „CRST/" erlaubt. Danach ist nur noch die Eingabe von bis zu 5 Stellen (alphanumerisch) möglich. Alle anderen Angaben werden je nach erfasster ISIN mit einer Fehlermeldung abgelehnt. **Verschlüsselung der ISIN in WSS ohne LGL/LGS 271/001** Die Instruktionseingabe bezieht sich ebenfalls auf Global Bearer Certificates. Die Instruktionseingabe muss ohne den Wert „CRST/" eingegeben werden. Stattdessen wird das Feld „LIEFERUNG-AN NAME" geprüft. Das entsprechende Feld "LIEFERUNG-AN NAME" muss den Wert „BIC/" und den dazugehörenden 8stelligen BIC aufweisen. Es wird geprüft, dass die ersten 6 Stellen nur Großbuchstaben und die letzten 2 Stellen Großbuchstaben oder Zahlen enthalten. Alle anderen Angaben werden mit Fehlerhinweis („FÜR DIESE ISIN NUR BIC DES KONTRAHENTEN MÖGLICH") abgelehnt.

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (vgl. Kapitel 2.3.7

Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen) gelten bei der Erfassung eines Rücktauschauftrages folgende Feldbesonderheiten:

AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
VWA	Die Verwahrart wird nach Eingabe der jeweiligen WKN automatisch vom System zugesteuert.
LAST	Das Last-Konto muss nachfolgender Kontoart entsprechen: – Kundenkonten
GUT	Das Gut-Konto wird automatisch mit dem Tresorkonto der CBF vorbelegt und ist nicht veränderbar.
WKN	Die eingegebene WKN muss die entsprechende Verwahrmöglichkeit ausweisen.
CBF-LAG	Ergibt sich aus der WKN und ist nicht veränderbar.
LIEFERUNG-AN NAME/ADRESSE	Siehe oben
BEGÜNSTIGTER	Hier kann der Endbegünstigte eingetragen werden, dessen Depot die Stücke über eine Drittbank oder einen Broker gutzuschreiben sind.

4.1.9.1.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST / GUT

Lastschrift-Konto und Gutschrift-Konto dürfen nicht gleich sein.

LAST / USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.

4.1.10 Erfassung Optionsscheintrennung (OT)

4.1.10.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Auftragsart Optionsscheintrennung kann die Bestandstrennung einer Optionsanleihe cum (WKN-Cum) in die Bestände Optionsanleihe ex (WKN-Ex) und nur Optionsscheine (WKN-Opt) durchgeführt werden. Bei der Auftragserteilung ist jeweils nur die gewünschte WKN und Nominale der Cum-Anleihe vorzugeben. Innerhalb der Disposition und Buchung werden die erforderlichen Zusatzbuchungen erzeugt und gebucht. Die Umsätze aus den Trennvorgängen können über ein abweichendes Depotkonto des Teilnehmers abgewickelt werden.

Nach Eingabe des Funktionscodes „OT" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

4.1.10.1.2 (B) Eingabemaske Optionsscheintrennung

```
TRAN: KVEE FC: OT SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG           OPT.TRENNUNG / ERFASSUNG          ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: ____            AUFTNR: __________        HLG: 01 GS

LAST     :
GUT      : 7926000         CBF W/OPT.TREN.U.BOND STRIPPING     /
WKN      : _ ____________                                      /

NOMINALE : ____________________    EINHEIT:          ST-ART:
SET-DAY  : 20.11.2014
KUNDENREFERENZ:     -                  -
ES WERDEN ZUSAETZLICH    BUCHUNGEN ZU GUNSTEN      ___ VORGENOMMEN:
 WKN                                                          NOMINALE/ST.




-- ID-KZ: 7930220003 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 08:51:01 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

4.1.10.1.3 (C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung eines Auftrages zur Optionsscheintrennung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	vorbelegt mit:
AUFTNR	
HLG	"GS" = Girosammelverwahrung
LAST	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
WKN	"I" änderbar in "W"
WKN	
NOMINALE	
SET-DAY	nächster Bankarbeitstag
ZU GUNSTEN-KONTO	Konto-Nummer der erfassenden Bank

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (vgl. Kapitel 2.3.7

Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen) gelten bei der Erfassung eines Auftrages zur Optionsscheintrennung folgende Feldbesonderheiten:

AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
HLG	Folgende Ausprägungen sind möglich: 01 = GS (Girosammelverwahrung) Die für die jeweilige WKN festgelegte Verwahrmöglichkeit muss mit der HLG-CBF übereinstimmen.
LAST	Die Kontonummern müssen nachfolgenden Kontoarten entsprechen: • Kundenkonten (auch Treuhand/Vorratslager/Rückgabe, Spezialabwicklung) • EUREX-Sicherheiten • Konto der CBF • Verleih-Konto
GUT	In diesem Feld wird automatisch ein internes Konto der CBF vorbelegt und ist nicht veränderbar.
WKN	Folgende Wertpapierarten sind für eine Opt.-Trennung zugelassen: • Optionsanleihe cum Optionsschein • Doppelwährungs-Optionsanleihe cum • Wandelanleihe cum OS • Zero-Optionsanleihe cum OS • Opt. Gen. Rechte cum.
BUCHUNGEN/ BUCHUNGS-ZEILE	Nach Datenfreigabe der Auftragsdaten wird gleichzeitig die Anzahl der möglichen Umsätze angezeigt. Angaben zu den einzelnen Zusatzbuchungen erfolgen jeweils mit der WKN, WP-Bezeichnung und Nominale in der Buchungszeile. Diese ergeben sich automatisch aus dem Trennungsverhältnis Optionsanleihe-cum in Optionsanleihe ex-Optionsscheine und nur-Optionsscheine. Bei mehr als sechs Zusatzbuchungen wird auf diesen Sachverhalt hingewiesen. Gebuchte Depotumsätze sind vollständig in der Umsatzanzeige (KVDU) abrufbar.
ZU-GUNSTEN-KTO	Haupt- und Unterkonto des zu-Gunsten-Kontos werden automatisch durch das System analog dem Last-Konto vorbelegt. Wird das Unterkonto des Last-Kontos durch den Eingeber verändert, verändert sich das zu-Gunsten-Konto nicht automatisch mit. Sofern gewünscht, kann die Unterkontonummer geändert werden.

4.1.10.1.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST / USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.

WKN / SETTLEMENT-DAY

Der Settlement-Day (auch der Settlement-Day Vortrag) muss innerhalb der Umtauschfrist für die eingegebene WKN liegen.

4.1.11 Erfassung Optionsscheinzusammenführung (OZ)

4.1.11.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Auftragsart Optionsscheinzusammenführung kann die Bestandszusammenführung aus den Beständen Optionsanleihe-ex (WKN/-Ex) und nur-Optionsscheine (WKN/-Opt) zur Optionsanleihe cum (WKN/-Cum) durchgeführt werden. Bei der Auftragserteilung ist jeweils nur die gewünschte WKN und Nominale der Cum-Anleihe vorzugeben. Innerhalb der Disposition und Buchung werden die erforderlichen Zusatzbuchungen erzeugt und gebucht. Die Umsätze aus den Vorgängen zur Zusammenführung können über ein abweichendes Depotkonto des Teilnehmers abgewickelt werden.

Nach Eingabe des Funktionscodes „OZ" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

4.1.11.1.2 (B) Eingabemaske Optionsscheinzusammenführung

```
TRAN: KVEE FC: OZ SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG    OPT.ZUSAMMENFUEHRUNG/ ERFASSUNG          ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: ____            AUFTNR: _________       HLG:  01 GS

LAST     : 7926000         CBF W/OPT.TREN.U.BOND STRIPPING     /
GUT      : ___________                                         /
WKN      : _ ____________

NOMINALE : ___________________    EINHEIT:          ST-ART:
SET-DAY  : 20.11.2014
KUNDENREFERENZ:     -                  -
ES WERDEN ZUSAETZLICH    BUCHUNGEN ZU LASTEN      ___ VORGENOMMEN:
 WKN                                                          NOMINALE/ST.









-- ID-KZ: 7930220003 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 08:52:47 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

4.1.11.1.3 (C) Feldbesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines Auftrages zur Optionsscheinzusammenführung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	vorbelegt mit:
AUFTNR	
HLG	"GS" = Girosammelverwahrung
GUT-KONTO	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
WKN-KENNUNG WKN	"I" änderbar in "W"
NOMINALE	
SET-DAY	nächster Bankarbeitstag
ZU-LASTEN-KONTO	internes Konto der CBF

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (vgl. Kapitel 2.3.7

Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen) gelten bei der Erfassung eines Auftrages zur Optionsscheinzusammenführung folgende Feldbesonderheiten:

AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
CBF	Folgende Ausprägungen sind möglich: 01 = GS (Girosammelverwahrung) Die für die jeweilige WKN festgelegte Verwahrmöglichkeit muss mit der HLG-CBF übereinstimmen.
LAST	In diesem Feld wird automatisch ein internes Konto der CBF vorbelegt und ist nicht veränderbar
GUT	Die Kontonummern müssen nachfolgenden Kontoarten entsprechen: • Kundenkonten (auch Treuhand/Vorratslager/Rückgabe, Spezialabwicklung) • EUREX-Sicherheiten • Verleih-Konto.
WKN	Folgende Wertpapierarten sind für eine Opt.-Trennung zugelassen: • Optionsanleihe cum Optionsschein • Doppelwährung-Optionsanleihe cum • Wandelanleihe cum OS • Zero-Optionsanleihe cum OS • Opt. Gen. Rechte cum
BUCHUNGEN/ BUCHUNGS-ZEILE	Nach Datenfreigabe der Auftragsdaten wird gleichzeitig die Anzahl der möglichen Umsätze angezeigt. Angaben zu den einzelnen Zusatzbuchungen erfolgen jeweils mit der WKN, WP-Bezeichnung und Nominale in der Buchungszeile. Diese ergeben sich automatisch aus dem Trennungsverhältnis Optionsanleihe ex-Optionsscheine und nur-Optionsscheine in Optionsanleihe-cum. Bei mehr als sechs Zusatzbuchungen wird auf diesen Sachverhalt hingewiesen. Gebuchte Depotumsätze sind vollständig in der Umsatzanzeige (KVDU) abrufbar.
ZU-GUNSTEN-KTO	Haupt- und Unterkonto des zu-Gunsten-Kontos werden automatisch durch das System analog dem Gut-Konto vorbelegt. Wird das Unterkonto des Gut-Kontos durch den Eingeber verändert, verändert sich das zu-Gunsten-Konto nicht automatisch mit. Sofern gewünscht, kann die Unterkontonummer geändert werden.

4.1.11.1.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

GUT / USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.

WKN / SETTLEMENT-DAY

Der Settlement-Day muss innerhalb der Umtauschfrist für die eingegebene WKN liegen.

4.1.12 Erfassung Strip-Aufteilung (SA)

4.1.12.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Auftragsart Strip-Aufteilung kann die Trennung einer cum-Anleihe (WKN/-Cum) in die Komponenten Mantel und Kupon durchgeführt werden. Bei der Auftragserteilung ist jeweils nur die stripfähige WKN und Nominale der Cum-Anleihe vorzugeben. Innerhalb der Disposition und Buchung werden die erforderlichen Zusatzbuchungen erzeugt und gebucht.

Hinweis: Während der Sperrfrist von sechs Arbeitstagen vor Zinszahlungen bzw. Rückzahlungen ist eine Strip-Aufteilung nicht möglich.

Nach Eingabe des Funktionscodes „SA" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

4.1.12.1.2 (B) Eingabemaske Strip-Aufteilung

```
TRAN: KVEE FC: SA SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG            STRIP-AUFTEILUNG / ERFASSUNG     ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE:                AUFTNR:                VWA:  GS

LAST     : ___________                                        /
GUT      : 7926000        CBF W/OPT.TREN.U.BOND STRIPPING     /
WKN      : I ____________

NOMINALE :                              EINHEIT :

SET-DAY  : 20.11.2014

STRIPPING-FORM: 2

TEXT   :




-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:           ------ C7930007 -- 19/11/14 -- 07:30:00 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

4.1.12.1.3 (C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung eines Auftrages zur Strip-Aufteilung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	vorbelegt mit:
AUFTNR	
VWA	„GS" = Girosammelverwahrung
LAST	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
GUT	"7926 000" (Abwicklungskonto CBF)
WKN-KENNUNG	„I" änderbar in „W"
NOMINALE	
SET-DAY	nächster Bankarbeitstag
STRIPPING-FORM	„2" (Trennung cum Anleihe in Mantel/Kupons)

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (vgl. Kapitel 2.3.7

Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen) gelten bei der Erfassung eines Auftrages zur Strip-Aufteilung folgende Feldbesonderheiten:

AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
LAST	Die Kontonummern müssen nachfolgenden Kontoarten entsprechen: • Kundenkonto nur Zentralen • Lagerstelle • Kundenkonto /Makler • internes Kundenkonto CBF
GUT	In diesem Feld wird automatisch ein internes Konto der CBF vorbelegt und ist nicht veränderbar.
WKN	Die WKN muss zur Strip-Aufteilung zugelassen sein. Es kann nur die CUM-WKN eingegeben werden.

4.1.12.1.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST/USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.

WKN/SETTLEMENT-DAY

Der Settlement-Day muss kleiner/gleich der möglichen Stripping-Frist sein, ab dem die eingegebene WKN aufteilbar ist.

4.1.13 Erfassung Strip-Zusammenführung (SZ)

4.1.13.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Auftragsart Strip-Zusammenführung kann die Zusammenführung aus den Stripping-Komponenten Mantel und Kupon zur cum-Anleihe (WKN-Cum) durchgeführt werden. Bei der Auftragserteilung ist jeweils nur die gewünschte WKN und Nominale der Cum-Anleihe vorzugeben. Innerhalb der Disposition und Buchung werden die erforderlichen Zusatzbuchungen erzeugt und gebucht.

Hinweis: Während der Sperrfrist von sechs Arbeitstagen vor Zinszahlungen bzw. Rückzahlungen ist eine Strip-Zusammenführung nicht möglich.

Nach Eingabe des Funktionscodes „SZ" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

4.1.13.1.2 (B) Eingabemaske Strip-Zusammenführung

```
TRAN: KVEE FC: SZ SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      STRIP-ZUSAMMENFUEHRUNG / ERFASSUNG     ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: ____           AUFTNR: _________       VWA:  GS

LAST     : 7926000      CBF W/OPT.TREN.U.BOND STRIPPING       /
GUT      : ___________                                        /
WKN      : I ____________

NOMINALE : ___________________          EINHEIT :

SET-DAY  : 20.11.2014

STRIPPING-FORM: 2

TEXT   : ____________________________________________________________________________




-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:           ------ C7930007 -- 19/11/14 -- 07:30:00 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

4.1.13.1.3 (C) Feldbesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines Auftrages zur Zusammenführung einer Anleihe sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

	vorbelegt mit:
AUFTNR	
VWA	"GS" = Girosammelverwahrung
LAST	"7926 000" (Abwicklungskonto CBF)
GUT	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
WKN-KENNUNG	"I" änderbar in "W"
	vorbelegt mit:
NOMINALE	
SET-DAY	nächster Bankarbeitstag

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (vgl. Kapitel 2.3.7

Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen) gelten bei der Erfassung eines Auftrages zur Strip-Zusammenführung folgende Feldbesonderheiten:

AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
GUT	Die Kontonummern müssen nachfolgenden Kontoarten entsprechen: • Kundenkonto nur Zentralen • Lagerstelle • Kundenkonto/Makler • internes Kundenkonto CBF
LAST	In diesem Feld wird automatisch ein internes Konto der CBF vorbelegt und ist nicht veränderbar.
WKN	Die WKN muss zur Strip-Zusammenführung zugelassen sein. Es kann nur die CUM-WKN eingegeben werden.

4.1.13.1.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

GUT/USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.

WKN/SETTLEMENT-DAY

Der Settlement-Day muss größer/gleich dem Stripping-Datum sein, ab dem die eingegebene WKN zusammenführbar ist.

4.2 Auftragsbearbeitung im Erfassungsstatus (EA)

4.2.1 Änderung von Aufträgen

Ein Auftrag kann im Erfassungsstatus nur dann geändert werden, wenn er *noch nicht kontrolliert* oder wenn er bei der Kontrolle als *fehlerhaft* gekennzeichnet wurde. Es können sowohl bereits vorhandene Daten durch Überschreiben der alten Feldinhalte geändert als auch neue Daten durch Füllen leerer Felder hinzugefügt werden.

Unter dieser Transaktion werden auch die im Auftragsstatus zur Änderung markierten und daraufhin in den Erfassungsstatus generierten Aufträge bearbeitet.

```
TRAN: KVEA FC:    SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG     A E N D E R U N G / L O E S C H U N G   ERFASSUNGSSTATUS
                                 GIROBEREICH


      AN   AENDERUNG EINES AUFTRAGES        : .........  (AUFTRAGS-NUMMER)
      AT   AENDERUNG EINER TEFRA-D FREIGABE : .........  (AUFTRAGS-NUMMER)
      AF   AENDERUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE


      LN   LOESCHUNG EINES AUFTRAGES        : .........  (AUFTRAGS-NUMMER)
      LF   LOESCHUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE









-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79074E4 -- 19/11/14 -- 11:50:57 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Folgende Funktionen sind möglich:

"AF" = Änderung fehlerhafter Aufträge

"AT" = Änderung einer TEFRA D Freigabe

"AN" = Änderung eines einzelnen Auftrages

4.2.1.1 Änderung fehlerhafter Aufträge (AF)

4.2.1.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit dem Einstieg „AF" werden alle vom Kontrolleur als fehlerhaft gekennzeichneten Aufträge angezeigt.

Zunächst erfolgt die tabellarische Kurzanzeige aller fehlerhaften Aufträge. Diese sind sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung.

Hier können nur die *buchungsrelevanten Felder* wiedergegeben werden. Mit Ausnahme des Feldes KZ sind alle Felder gesperrt, d. h. in dieser Kurzanzeige kann *nicht geändert* werden.

4.2.1.1.2 (B) Tabellarische Anzeige/Änderung Erfassungsstatus

```
TRAN: KVEA FC: AF SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRAEGE / AENDERUNG              ERFASSUNGSSTATUS
                                GIROBEREICH
                                                                      SEITE   1

KZ PRIM     AUFTNR LAST GUT  WKN                 NOMINALE              GEGENWERT

.          7321962 7930 6789 DE0005003211               200
.     1         45 7930 5678 DE0005003211                50









-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 09:09:09 --

PF3:VERARBEITUNG  PF4:ABBRUCH
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"I"= Selektion des Auftrages zur Vollanzeige

"X"= Selektion des Auftrages zur Änderung

4.2.1.1.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Das Kennzeichen in der ersten Spalte (KZ) gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages an. Da es sich bei allen Aufträgen um fehlerhafte Aufträge handelt, wird das Kennzeichen immer leer angezeigt.

Es ist jeweils nur *ein „I"* bzw. *ein „X"* auf einer Maskenseite erlaubt, d. h. es können nicht gleichzeitig mehrere Aufträge zur Vollanzeige selektiert werden.

„X" und „I" dürfen auch nicht miteinander kombiniert werden.

Der einzige Unterschied zwischen „X" und „I" besteht darin, dass man nach „I" nicht ändern kann, während man nach „X" den Auftrag in der Vollanzeige ändern darf.

Zur Änderung wird der gewünschte Auftrag durch Eingabe eines „X" in der Spalte KZ der entsprechenden Zeile ausgewählt.

Nach Datenfreigabe werden dem Benutzer *alle bisher gespeicherten Daten* des Auftrages angezeigt.

4.2.1.1.4 (D) Vollanzeige/Änderung WP-Übertrag

```
TRAN: KVEA FC: AN SB: 000001723##

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / AENDERUNG            ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE:  256           AUFTNR:      1723      VWA: GS  GS,    TR: _

LAST     : 7931000        HANDELSBANK AG                      / BANKDEFFXXX
GUT      : 7930000        TESTBANK AG                         / TESTDEFFXXX
WKN      : I DE0007236101 SIEMENS AG NA

NOMINALE :             1.000       EINHEIT: ST          DISPO-PRIORITAET: 4 MST
GEGENWERT:                         WRG    :             PARTY HOLD (J/N): N
DCA/REF:                                                 EMISS-EINF (J/N): N

SET-DAY  : 20.11.2014              EX-TRD :             BATM/ADEA  (J/N): N
BOERSENPL: ____                    OPT-OUT:             RTS-DVP    (J/N): N

SCHLUSSTAG: 19.11.2014             REFERENZ-NR      :
KURS / WRG: ___________ ___        AUFTRAGS-REFERENZ:
                                   GEGEN-AUFTNR     :

-- ID-KZ: 7931260001 -- PW:          ------ B79313FX -- 19/11/14 -- 14:21:33 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

In dieser *Vollanzeige* können jetzt die vorgesehenen *Änderungen* eingegeben werden. Neben der Prüfung, ob alle Mussfelder vorhanden sind, werden die Eingaben auf formale Richtigkeit und auf gültige Abhängigkeiten zueinander geprüft. Es werden dieselben Folgemasken und Plausibilitäten wie in der Erfassung angewandt.

Nach der Verarbeitung mit PF3 kehrt das System zur tabellarischen Kurzanzeige zurück, in der der Benutzer den nächsten zu ändernden Auftrag auswählen kann. Nach der Änderung eines fehlerhaften Auftrages wird dieser Auftrag aus der tabellarischen Anzeige entfernt, da er jetzt nicht mehr als fehlerhaft gilt. Sind alle fehlerhaften Aufträge abgearbeitet, kehrt das System automatisch in die Menümaske zurück.

4.2.1.2 Änderung eines Auftrages über die Auftragsnummer (AN)

4.2.1.2.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Kennt der Benutzer die Auftragsnummer des zu ändernden Auftrages, steigt er mit dem Transaktionscode KVEA und dem Funktionscode „AN" sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erfolgt die Vollanzeige *aller bisher gespeicherten Daten* dieses Auftrages.

Unter der Funktion „AN" sind folgende Aufträge änderbar:

- ein noch nicht kontrollierter Auftrag
- ein in der Kontrolle als fehlerhaft markierter Auftrag
- ein aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Auftrag

4.2.1.3 Änderung einer TEFRA D Freigabe über die Auftragsnummer (AT)

4.2.1.3.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Kennt der Benutzer die Auftragsnummer der zu ändernden TEFRA D Freigabe, steigt er mit dem Transaktionscode KVEA und dem Funktionscode „AT" sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erfolgt die Vollanzeige aller bisher gespeicherten Daten dieses Auftrages.

Unter der Funktion „AT" sind folgende TEFRA D Freigaben änderbar:

- ein noch nicht kontrollierter Freigabeauftrag
- ein in der Kontrolle als fehlerhaft markierter Freigabeauftrag
- ein aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Freigabeauftrag

4.2.2 Löschung von Aufträgen (EA)

Ein Auftrag oder eine TEFRA D Freigabe kann im Erfassungsstatus nur dann gelöscht werden, wenn er *noch nicht kontrolliert* oder wenn er bei der Kontrolle als *fehlerhaft* gekennzeichnet wurde.

```
TRAN: KVEA FC:    SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG     A E N D E R U N G / L O E S C H U N G   ERFASSUNGSSTATUS
                                GIROBEREICH


      AN   AENDERUNG EINES AUFTRAGES        : .........  (AUFTRAGS-NUMMER)
      AT   AENDERUNG EINER TEFRA-D FREIGABE : .........  (AUFTRAGS-NUMMER)
      AF   AENDERUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE


      LN   LOESCHUNG EINES AUFTRAGES        : .........  (AUFTRAGS-NUMMER)
      LF   LOESCHUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE









-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79074E4 -- 19/11/14 -- 11:50:57 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Folgende Funktionen sind möglich:

"LN" = Löschung eines einzelnen Auftrages

"LF" = Löschung fehlerhafter Aufträge

4.2.2.1 Löschung fehlerhafter Aufträge (LF)

4.2.2.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit dem Einstieg „LF" werden alle vom Kontrolleur als fehlerhaft gekennzeichneten Aufträge angezeigt.

Zunächst erfolgt die tabellarische Kurzanzeige aller fehlerhaften Aufträge. Diese sind sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung.

Hier können nur die *buchungsrelevanten Felder* wiedergegeben werden. Mit Ausnahme des Feldes KZ sind alle Felder gesperrt. Nur hier in der Kurzanzeige können Aufträge gelöscht, d. h. *Löschkennzeichen* in den entsprechenden Zeilen gesetzt werden.

4.2.2.1.2 (B) Tabellarische Anzeige/Löschung Erfassungsstatus

```
TRAN: KVEA FC: LF SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRAEGE / LOESCHUNG              ERFASSUNGSSTATUS
                                GIROBEREICH
                                                                      SEITE   1

KZ PRIM    AUFTNR LAST GUT  WKN                    NOMINALE            GEGENWERT

_          7644962 7930 6789 DE0005003211            200
_     1         45 7930 5678 DE0005005432             50









-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 09:09:09 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"I"= Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

"X"= Löschung des Auftrages

4.2.2.1.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische anzeige

Das Kennzeichen in der ersten Spalte (KZ) gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages an. Da es sich bei allen Aufträgen um fehlerhafte Aufträge handelt, wird das Kennzeichen immer leer angezeigt.

Es darf jeweils nur *ein „I"* auf einer Maskenseite eingegeben werden, da nur ein Auftrag zur Vollanzeige selektiert werden kann.

„X" und „I" dürfen nicht miteinander kombiniert werden. Es ist jedoch möglich, mehrere Aufträge auf einer Seite mit „X" zur Löschung zu kennzeichnen.

4.2.2.2 Löschung eines Auftrages über die Auftragsnummer (LN)

4.2.2.2.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Kennt der Benutzer die Auftragsnummer des zu löschenden Auftrages oder der TEFRA D Freigabe, steigt er mit dem Transaktionscode KVEA und dem Funktionscode "LN" sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erfolgt die tabellarische Kurzanzeige der buchungsrelevanten Daten dieses Auftrages.

Im Unterschied zur Änderung eines einzelnen Auftrages wird bei der Löschung über den Einstieg "LN" die tabellarische Form des Auftrages angezeigt, da nur dort das *Löschkennzeichen* gesetzt werden kann.

Unter „LN" können folgende Aufträge gelöscht werden:

- ein noch nicht kontrollierter Auftrag
- ein in der Kontrolle als fehlerhaft markierter Auftrag

4.2.3 Information Erfassungsstatus (EI)

4.2.3.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Im Informationsdienst des Erfassungsstatus können sich die Teilnehmer über selbst eingestellte Aufträge informieren. Es besteht *nicht* die Möglichkeit, von hier aus zu ändern oder zu löschen.

Der Informationsdienst bietet folgende Möglichkeiten:

- Anzeige des Bearbeitungszustandes eines Auftrages (nicht kontrolliert / fehlerhaft)
- Tabellarische Kurzanzeige mehrerer Aufträge
- Vollanzeige eines Auftrages mit allen erfassten Informationen
- Online Druck mit allen erfassten Informationen zu einem Auftrag

4.2.3.1.2 (B) Auswahlmaske Information/Erfassungsstatus

```
TRAN: KVEI FC:    SB: ######

AUFTRAGSABWICKLUNG             I N F O R M A T I O N           ERFASSUNGSSTATUS


                    AA   ALLE AUFTRAEGE
                    AF   ALLE FEHLERHAFTEN AUFTRAEGE

                    NR   AUFTRAGS-NUMMER   : __________     EINGEBER: ____
                    PN   PRIMANOTEN-NUMMER : ____
                    LK   LASTSCHRIFT-BANK  :
                    GK   GUTSCHRIFT-BANK   : ____


                    ZUSAETZLICHE AUSWAHL - WKN : _ ____________









-- ID-KZ: 7930220003 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 11:38:48 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

4.2.3.1.3 (C) Mögliche Funktionen

"AA" = Alle Aufträge

"AF" = Alle Fehlerhaften Aufträge

Zusätzliche Eingaben sind zu den folgenden Funktionen erforderlich:

"NR" = Auftrags-Nummer

"PN" = Primanoten-Nummer

"LK" = Lastschrift-Bank

"GK" = Gutschrift-Bank

Zusätzliche Eingaben zur Eingrenzung der Auswahl:

Mit der Zusatzeingabe im Feld „WKN" wird die Auswahl nochmals eingegrenzt.

Bei allen Abfragen in den einzelnen Funktionscodes erfolgt *zuerst* eine tabellarische Anzeige aller mit dem Funktionscode übereinstimmenden Aufträge. Angezeigt wird immer der aktuelle Zustand des Auftrages, da im Erfassungsstatus keine Historie geführt wird.

Bereits kontrollierte Aufträge sind aus dem Erfassungsbestand des Eingebers in die Auftragsdatenbank der CBF übergegangen und werden im Informationsdienst des Erfassungsstatus nicht mehr angezeigt.

Das Kennzeichen in der ersten Spalte (KZ) gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages an.

Möglicher Bearbeitungsstatus:

" " = nicht kontrollierter Auftrag

"F" = fehlerhafter Auftrag

"A" = aus dem Auftragsstatus zum Ändern generiert

"L" = aus dem Auftragsstatus zum Löschen generiert

Hinweis:

Beim Einstieg über den Funktionscode „AF" (fehlerhafte Aufträge) werden alle Aufträge mit dem Bearbeitungszustand

" " angezeigt, der in diesem speziellen Fall für fehlerhafte Aufträge steht.

Mit der Eingabe der Funktion „AA" wird eine tabellarische Auswahl angeboten.

4.2.3.1.4 (D) Auswahlmaske Information/Tabellarische Anzeige Aufträge

```
TRAN: KVEI FC: AA SB: W##

AUFTRAGSABWICKLUNG            AUFTRAEGE / INFORMATION          ERFASSUNGSSTATUS

                                                                        SEITE   1

K PRIM    AUFTNR LAST  GUT WKN                 NOMINALE                GEGENWERT

_    1   4444444 6789 7930 DE0007664000            500
_  444   1234567 6789 7930 DE0007664000             10
_    0   1000309 7930 5678 DE0008474041      1.000.000
_  999   1001222 5678 7930 DE0007463861      2.000.000









GESAMTSUMMEN  ANZAHL AUFTRAEGE:      4       3.000.510

-- ID-KZ: 7930220003 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 11:39:27 --

PF3:Rücksprung  PF4:AbbruchEingebbares Kennzeichen (KZ):
```

"I" = Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

Wird vor einem Auftrag das Feld KZ mit „I" überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller erfassten Felder, ggf. über mehrere Masken (für bestimmte Auftragsarten).

4.2.3.1.5 (E) Vollanzeige von Aufträgen/Information Erfassungsstatus

```
TRAN: KVEI FC: NR SB: 0007592212

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / INFORMATION          ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE:                AUFTNR:  7592212         VWA: GS         TR:

LAST     : 7930000        TESTBANK AG                          / TESTDEFFXXX
GUT      : 7931000        HANDELSBANK AG                       / BANKDEFFXXX
WKN      : I DE0005000941 MNO AKTIEN

NOMINALE :             2.700       EINHEIT: ST          DISPO-PRIORITAET: 4 MST
GEGENWERT:                         WRG    :             PARTY HOLD (J/N): N
DCA/REF :                                               EMISS-EINF (J/N): N

SET-DAY  : 19.11.2014              EX-TRD :             BATM/ADEA  (J/N): N
BOERSENPL:                         OPT-OUT:             RTS-DVP    (J/N): N

SCHLUSSTAG: 19.11.2014             REFERENZ-NR      :
KURS / WRG:                        AUFTRAGS-REFERENZ:
                                   GEGEN-AUFTNR     :

-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 07:55:00 --

PF2:Druck  PF3:Ruecksprung  PF4:Abbruch
```

Von der Vollanzeige aus kann mittels PF2 ein *Online Druck* des angezeigten Auftrages erfolgen. Wenn die Vollanzeige sich über mehrere Masken erstreckt, werden alle Maskeninhalte ausgedruckt, unabhängig davon, in welcher Maske der Online Druck initiiert wurde.

4.3 Kontrolle (EK)

Um die erfassten Aufträge und TEFRA D Freigaben verbindlich an die CBF zu erteilen, muss das **Vier-Augen-Prinzip** gewahrt werden, d. h. die vom Erfasser in das System eingegebenen Aufträge werden von einer zweiten Person kontrolliert. Vom System wird sichergestellt, dass der Kontrolleur ein vom Erfasser abweichendes ID-KZ hat.

Die Kontrolle bietet folgende Möglichkeiten:

- Kontrolle über Vollanzeige
- Kontrolle über tabellarische Kurzanzeige

Die Bank muss im Rahmen der Security-Angaben entscheiden, über welches Verfahren ihre Kontrolleure Aufträge kontrollieren sollen.

```
TRAN: KVEK FC:    SB: ########I#

AUFTRAGSABWICKLUNG              K O N T R O L L E              ERFASSUNGSSTATUS
                                   GIROBEREICH

   VOLLANZEIGE                                TABELLARISCHE KURZANZEIGE


   VA   ALLE AUFTRAEGE                        TA   ALLE AUFTRAEGE
   VN   AUFTRAGS-NUMMER   : _________        TN   AUFTRAGS-NUMMER   : _________
   VP   PRIMANOTEN-NUMMER :                   TP   PRIMANOTEN-NUMMER :
   VL   LASTSCHRIFT-BANK  : ____              TL   LASTSCHRIFT-BANK  : ____
   VG   GUTSCHRIFT-BANK   : ____              TG   GUTSCHRIFT-BANK   : ____


                    ZUSAETZLICHE AUSWAHL - WKN : I ____________




-- ID-KZ: 7930220003 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 11:44:41 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Zusätzliche Eingaben sind zu den folgenden Funktionen erforderlich:

"VN" / "TN" = Auftrags-Nummer

"VP" / "TP" = Primanoten-Nummer

"VL" / "TL" = Lastschrift-Bank

"VG" / "TG" = Gutschrift-Bank

Zusätzlich ist die Eingabe einer Wertpapierkennung bei allen Funktionscodes erlaubt und bewirkt die Einschränkung der zu bearbeitenden Aufträge auf eine bestimmte Gattung.

4.3.1 Kontrolle über die Vollanzeige (EK)

4.3.1.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Ausgehend von der Hauptauswahl gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes „EK" in das Menü Kontrolle.

Kontrolle über Vollanzeige bedeutet, dass dem Kontrolleur alle zu den eingegebenen Auswahlkriterien gefundenen Aufträge (sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung) hintereinander mit *allen gespeicherten Daten* angezeigt werden. So hat er die Möglichkeit, alle Daten eines Auftrages zu überprüfen. Erst auf der letzten Seite eines Auftrages erscheint das Feld für das Kontrollkennzeichen.

Die verschiedenen Funktionscodes für die Vollanzeige unterscheiden sich lediglich im Umfang der ausgewählten Aufträge.

Hinweis:

Angabe der Primanoten-Nummer "0" bei Einstieg mit dem Funktionscode "VP" bedeutet, dass alle Aufträge angezeigt werden, die keiner Primanote zugeordnet sind.

Innerhalb eines Auftrages, der über mehrere Seiten geht, bewegt sich der Kontrolleur mit PF8 vorwärts bzw. mit PF7 rückwärts. Wenn er auf der letzten Seite das Kontrollkennzeichen setzt, drückt er PF3 zur Verarbeitung. Es folgt die erste Seite des nächsten zu kontrollierenden Auftrages.

4.3.1.1.2 (B) Vollanzeige eines zu kontrollierenden Auftrages

```
TRAN: KVEK FC: VN SB: 000001723##

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / KONTROLLE             ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE:  256           AUFTNR:      1723      VWA: GS  GS,    TR:

LAST     : 7931000        HANDELSBANK AG                      / BANKDEFFXXX
GUT      : 7930000        TESTBANK AG                         / TESTDEFFXXX
WKN      : I DE0007236101 SIEMENS AG NA

NOMINALE :             1.000       EINHEIT: ST          DISPO-PRIORITAET: 4 MST
GEGENWERT:                         WRG    :             PARTY HOLD (J/N): N
DCA/REF :                                                EMISS-EINF (J/N): N

SET-DAY  : 19.11.2014              EX-TRD :             BATM/ADEA  (J/N): N
BOERSENPL:                         OPT-OUT:             RTS-DVP    (J/N): N

SCHLUSSTAG: 19.11.2014             REFERENZ-NR      :
KURS / WRG:                        AUFTRAGS-REFERENZ:
                                   GEGEN-AUFTNR     :

-- ID-KZ: 7931260001 -- PW:          ------ B79313FX -- 19/11/14 -- 14:34:46 --

PF2:Druck  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Erste Folgemaske:

```
TRAN: KVEK FC: VN SB: 000001723#I#

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / KONTROLLE-2           ERFASSUNGSSTATUS

                 PRIMANOTE:  256     AUFTNR:      1723     WKN: I DE0007236101

UEB-GRUND  :

EXT SET-DAY:                          RUECKUEBERTRAG (J/N)    : N
ALREADY MATCHED (J/ ):                PARTIAL SETTL INDICATOR:
ISO TRANSACTION CODE :

BELEGSCHAFT-SP: N                     SP-DATUM:
KUPONINFO/RECORD-DATE:




TEXT:


-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79303FX -- 19/11/14 -- 14:39:00 --

PF2:Druck  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

Zweite Folgemaske:

```
TRAN: KVEK FC: VN SB: 000001723#I#

AUFTRAGSABWICKLUNG         WP-UEBERTRAG / KONTROLLE FOLGE      ERFASSUNGSSTATUS

                 PRIMANOTE:  256     AUFTNR:      1723     WKN: I DE0007236101

SETTL PARTY - LIEFERER
P1:
P2:
P3:
P4:
P5:

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1:
P2: KTO 00641
P3:
P4:
P5:

KONTROLLKENNZEICHEN: _
-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79303FX -- 19/11/14 -- 14:40:43 --

PF2:Druck  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"K" = Der Auftrag ist kontrolliert und wird nach PF3 als verbindlicher Auftrag an die Clearstream Banking AG, Frankfurt übergeben.

"F" = Der Auftrag ist fehlerhaft und verbleibt im Erfassungsstatus.

" " = Der Auftrag ist noch nicht kontrolliert.

4.3.1.1.3 (C) Abhängigkeitsprüfungen und Feldeingabemöglichkeiten

Im Feld „Kontrollkennzeichen" (KZ) wird der Bearbeitungsstatus des Auftrages angezeigt.

Mögliche Bearbeitungsstatus:

" " = nicht kontrollierter Auftrag

"F" = fehlerhafter Auftrag

"A" = aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Auftrag

"L" = aus dem Auftragsstatus zur Löschung generierter Auftrag

Einziges eingabefähiges Feld auf der letzten Seite eines Auftrages ist das Kontrollkennzeichen.

Nach betätigen der PF3 Taste wird die erste Seite des nächsten Auftrages mit einer Verarbeitungsbestätigung für den vorherigen Auftrag angezeigt:

4.3.1.1.4 (D) Vollanzeige WP-Übertrag / Setzen Kontrollkennzeichen

```
TRAN: KVEK FC: VG SB: 7930#I#

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / KONTROLLE             ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE:                AUFTNR:      1111      VWA: GS  GS,    TR:

LAST     : 7931000        HANDELSBANK AG                      / BANKDEFFXXX
GUT      : 7930000        TESTBANK AG                         / TESTDEFFXXX
WKN      : I DE0008404005 ALLIANZ SE VNA O.N.

NOMINALE :             1.000       EINHEIT: ST          DISPO-PRIORITAET: 4 MST
GEGENWERT:            91.500,00    WRG    : EUR         PARTY HOLD (J/N): N
DCA/REF:                                                EMISS-EINF (J/N): N

SET-DAY  : 19.11.2014              EX-TRD :             BATM/ADEA  (J/N): N
BOERSENPL:                         OPT-OUT:             RTS-DVP    (J/N): N

SCHLUSSTAG: 19.11.2014             REFERENZ-NR      :
KURS / WRG:                        AUFTRAGS-REFERENZ:
                                   GEGEN-AUFTNR     :

-- ID-KZ: 7930260002 -- PW:          ------ B79303FY -- 19/11/14 -- 15:19:36 --
KV0022F PF-Taste nicht zulässig
PF2:Druck  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

```
TRAN: KVEK FC: VG SB: 7930#I#

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / KONTROLLE-2           ERFASSUNGSSTATUS

                 PRIMANOTE:          AUFTNR:      1111     WKN: I DE0008404005

UEB-GRUND  :

EXT SET-DAY:                         RUECKUEBERTRAG (J/N)   : N
ALREADY MATCHED (J/ ):               PARTIAL SETTL.INDICATOR:
ISO TRANSACTION CODE :

BELEGSCHAFT-SP: N                    SP-DATUM:
KUPONINFO/RECORD-DATE:




TEXT:


-- ID-KZ: 7930260002 -- PW:          ------ B79303FY -- 19/11/14 -- 15:20:31 --

PF2:Druck  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

```
TRAN: KVEK FC: VG SB: 6662#I#

AUFTRAGSABWICKLUNG         WP-UEBERTRAG / KONTROLLE FOLGE      ERFASSUNGSSTATUS

                 PRIMANOTE:          AUFTNR:      1111     WKN: I DE0008404005

SETTL PARTY - LIEFERER
P1:
P2:
P3:
P4:
P5:

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1:
P2:
P3:
P4:
P5:

KONTROLLKENNZEICHEN: _
-- ID-KZ: 7930260002 -- PW:          ------ B79073FY -- 19/11/14 -- 15:20:42 --

PF2:Druck  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

4.3.2 Kontrolle über die tabellarische Kurzanzeige (EK)

4.3.2.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Ausgehend von der Hauptauswahl gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes „EK" in das Menü Kontrolle.

Kontrolle über tabellarische Kurzanzeige bedeutet, dass dem Kontrolleur alle zu den eingegebenen Auswahlkriterien gefundenen Aufträge (sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung) in tabellarischer Form angezeigt werden. Diese Form der Kontrolle ist angebracht, wenn die *buchungsrelevanten Daten* der Aufträge für die Kontrolle ausreichen. Auf einer Seite der tabellarischen Kurzanzeige können die Aufträge dann entweder als Einzel- oder Blockkontrolle freigegeben werden.

Die verschiedenen Funktionscodes für die tabellarische Kurzanzeige unterscheiden sich lediglich im Umfang der ausgewählten Aufträge.

Hinweis: Angabe der Primanoten-Nummer „0" bei Einstieg mit dem Funktionscode „TP" bedeutet, dass alle Aufträge angezeigt werden, die keiner Primanote zugeordnet sind.

In der tabellarischen Kurzanzeige werden die selektierten Aufträge sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung zur Verfügung gestellt.

Im Feld „Kontrollkennzeichen" (KZ) wird der Bearbeitungszustand des Auftrages angezeigt:

" " = nicht kontrollierter Auftrag

"F" = fehlerhafter Auftrag

"A" = aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Auftrag

"L" = aus dem Auftragsstatus zur Löschung generierter Auftrag

Mögliche Kontrollvorgänge:

- Einzeln (Kennzeichen vor jedem einzelnen Auftrag) oder
- als Block (Kontrollkennzeichen am Ende der angezeigten tabellarischen Auswahl)

kontrolliert werden. Der Kontrolleur kann beide Möglichkeiten mischen, d. h. er kann eine Seite als Block und die nächste Seite mit Einzelkontrollen abarbeiten.

Eingabefähige Felder auf dieser Maske sind die Kontrollkennzeichen am Anfang jeder Zeile der Tabelle (für die *Einzelkontrolle*) sowie das Kontrollkennzeichen unterhalb der Tabelle (für die *Blockkontrolle*).

4.3.2.1.2 (B) Tabellarische Anzeige der zu kontrollierenden Aufträge

```
TRAN: KVEK FC: TA SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG              AUFTRAEGE / KONTROLLE           ERFASSUNGSSTATUS

                                                                        SEITE   1

KZ PRIM    AUFTNR LAST GUTO  WKN          NOMINALE                     GEGENWERT

_          1275921 7930 4567  DE0005000908          1.500              450.100,00
_   234        453 7930 6789  DE0005003002            200
             75922 7930 5678  DE0004895132             50,876









KONTROLLKENNZEICHEN: _

-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 11:11:11 --

PF3:VERARBEITUNG  PF4:ABBRUCH  PF8:VOR
```

Eingebbare Zeilenkennzeichen:

"K" = Der Auftrag ist kontrolliert und wird nach PF3 als verbindlicher Auftrag an CBF übergeben.

"I" = Vollanzeige eines einzelnen Auftrages zur Information

"F" = Der Auftrag ist fehlerhaft und verbleibt im Erfassungsstatus.

" " = Der Auftrag ist noch nicht kontrolliert.

Der Benutzer kann nur einen Auftrag für die Vollanzeige auswählen, d. h. er darf in der Spalte KZ nur *ein „I"* eingeben. Außerdem darf „I" nicht mit anderen Eingaben kombiniert werden, z. B. mit einem „F" in einer Zeile oder einem „K" im Kennzeichen Gesamtkontrolle. Es ist jedoch möglich, ein „I" einzugeben, wenn beim ersten Einstieg in die tabellarische Anzeige ein bereits als fehlerhaft gekennzeichneter Auftrag mit "F" erscheint und somit überschrieben wird.

Jedoch können *mehrere Aufträge* der Tabelle *mit „F" bzw. „K"* gekennzeichnet werden, d. h. diese beiden Eingaben sind miteinander kombinierbar.

Werden in den einzelnen Zeilen Aufträge mit „K" gekennzeichnet, darf das Kennzeichen Gesamtkontrolle nicht gesetzt werden.

Einzige Eingabemöglichkeit für das Kennzeichen Gesamtkontrolle ist „K" für Kontrolle aller Aufträge dieser Seite. Einzelne Aufträge kann man von dieser Kontrolle ausnehmen, indem man sie in der Zeile mit „F" kennzeichnet.

Eingebbares Kontrollkennzeichen:

"K" = Alle Aufträge dieser Seite (mit Ausnahme der mit „F" gekennzeichneten) sind damit kontrolliert und werden nach PF3 verbindlich an die Clearstream Banking AG übergeben.

4.3.3 Kombination Einzelkontrolle/Blockkontrolle

In bestimmten Fällen können sowohl in den Zeilenkennzeichen als auch im Kennzeichen Blockkontrolle Eingaben gemacht werden.

Will der Benutzer auf einer Seite nur einen Posten kontrollieren, dann setzt er vor dem gewünschten Auftrag ein „K".

Will er auf einer Seite einen Posten als fehlerhaft kennzeichnen, während alle anderen Posten kontrolliert werden sollen, setzt er vor dem fehlerhaften Auftrag ein „F" und in das Kontrollkennzeichen unter der Tabelle ein „K".

Soll auf einer Seite ein Auftrag als unkontrolliert stehen bleiben, während alle anderen Aufträge kontrolliert werden können, so muss er vor jedem kontrollierten Auftrag ein „K" setzen, während das Kontrollkennzeichen des unkontrollierten Auftrages leer bleibt.

Nach PF3 blättert das System auf die nächste Seite der tabellarischen Anzeige mit weiteren zu kontrollierenden Aufträgen. Auf dieser Seite wird die Verarbeitung der vorherigen Seite bestätigt. Wenn PF3 auf der letzten Seite gedrückt wird, kehrt das System zum Menü der Kontrolle zurück und gibt ebenfalls eine Verarbeitungsbestätigung aus.

Jeder mit „F" gekennzeichnete Auftrag bleibt im Erfassungsstatus stehen und muss vom Erfasser mit dem Vorgang „Änderung im Erfassungsstatus (EA)" berichtigt werden. Alle kontrollierten Aufträge werden verbindlich an die CBF übergeben.

Nach erfolgter Kontrolle werden verschiedene Verarbeitungsschritte angestoßen, die im Rahmen des Übergangs vom Erfassungs- in den Auftragsstatus durchlaufen werden müssen und am Ende dieses Kapitels beschrieben sind.

4.4 Auftragsbearbeitung im Auftragsstatus (AA)

4.4.1 Markierung zur Änderung (MA)

4.4.1.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Auch Aufträge, die sich bereits im CASCADE-Auftragsstatus befinden, können unter bestimmten Voraussetzungen noch geändert werden. Dies gilt auch für Match-Instruktionen. Match-Instruktionen frei von Zahlung, die durch die Nutzung des Match-Service als „Passiv Matcher" für ein betroffenes Konto systemseitig generiert wurden, können nicht zur Auftragsbearbeitung markiert werden.

Änderungen sind jedoch nicht direkt im Auftragsstatus möglich. *Die Aufträge werden im Auftragsstatus nur markiert und damit in den Erfassungsstatus überführt.* Dieses Verfahren ist notwendig, um auch für Änderungen im Auftragsstatus das Vier-Augen-Prinzip sicherzustellen. Änderungen können nur vom Eingeber vorgenommen werden.

Folgende Schritte laufen dabei ab:

1. Markierung des zu ändernden Auftrages im Auftragsstatus
2. Herausnahme des markierten Auftrages aus dem Auftragsstatus und Ablegen in die Historie des Auftragsstatus
3. Generierung des markierten Auftrages in den Erfassungsstatus
4. Änderung des generierten Auftrages im Erfassungsstatus
5. Kontrolle des geänderten Auftrages im Erfassungsstatus
6. Übergang des geänderten Auftrages aus dem Erfassungsstatus in den Auftragsstatus als Neuauftrag

Die Markierung zur Änderung im Auftragsstatus ist nicht möglich für bereits bestätigte Match-Aufträge/Match-Instruktionen (Status „matched").

```
TRAN: KVAA FC:    SB: #####

AUFTRAGSABWICKLUNG      A E N D E R U N G / L O E S C H U N G    AUFTRAGSSTATUS


MA   MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR AENDERUNG

ML   MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR LOESCHUNG

AA   AENDERUNG EINES AUFTRAGES FUR PARTIAL
     SETTL.INDICATOR UND DISPO-PRIORITAET
                                              AUFTRAGS-NUMMER   : .........



LM   LOESCHEN MASCHINELL ERZEUGTER AUFTRAEGE
                                              AUFTRAGS-NUMMER   : .........
                                              AUFTRAGSURSPRUNG  : ...
                                              EINGEBER          : ....


-- ID-KZ: 7930000099 -- PW:          ------ B79304E4 -- 19/11/14 -- 17:27:58 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

*** „LM" kann nur von CBF genutzt werden, „AA" kann zurzeit noch nicht genutzt werden

Um einen Auftrag zur Änderung markieren zu können, muss dessen Auftragsnummer bekannt sein. Der Benutzer steigt also mit dem Transaktionscode KVAA und dem Funktionscode „MA" sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erscheint die tabellarische Anzeige des ausgewählten Auftrages.

4.4.1.1.2 (B) Tabellarische Anzeige/Markierung zur Änderung

```
TRAN: KVAA FC: MA SB: 000107779

AUFTRAGSABWICKLUNG              AUFTRAEGE / MARKIERUNG           AUFTRAGSSTATUS

LAST-KTO: 7930 000                                                    SEITE   1


K M S D AA SA   AUFTNR GUT  WKN             NOMINALE            GEGENWERT SET-D

_   0 4 01 3    107779 7399 DE0009225401  20.354.980                     19.11









-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 08:50:20 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"I" = Selektion des Auftrages zur Vollanzeige

"X" = Markierung des Auftrages zur Änderung

4.4.1.1.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es kann nur ein Auftrag mit „I" oder „X" gekennzeichnet werden.

4.4.1.1.4 (D) Vollanzeige von Aufträgen/Information Auftragsstatus

Wird vor dem Auftrag im Feld KZ ein „I" eingegeben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller gespeicherten Daten dieses Auftrages, ggf. über mehrere Masken (bei bestimmten Auftragsarten).

Das Verzweigen in die Vollanzeige/Information kann notwendig werden, wenn die tabellarische Information nicht ausreicht.

Mit PF3 kehrt man in die tabellarische Kurzanzeige zurück.

4.4.1.1.5 (E) Markierung zur Änderung

In der tabellarischen Kurzanzeige wird der Auftrag mit einem „X" zur Änderung markiert.

Nach Bestätigung der Markierung mit PF3 springt das System in das Menü der Änderung/Löschung zurück und gibt dort eine Verarbeitungsbestätigung aus.

Der markierte Auftrag wird mit dem internen Status „Auftrag zur Änderung markiert, nicht mehr zur Verarbeitung heranziehen" versehen. Außerdem werden Datum, Uhrzeit, Terminal und User-ID der Markierung festgehalten. Der Auftrag ist im Informationsdienst des Auftragsstatus als historischer Auftrag abrufbar.

Anschließend wird der markierte Auftrag in den Erfassungsstatus des Eingebers generiert. Dort kann er dann geändert werden. Nach erfolgter Kontrolle wird er als Neuauftrag in den Auftragsstatus der CBF übernommen.

4.4.2 Markierung zur Löschung (ML)

4.4.2.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Auch Aufträge, die sich bereits im CASCADE Auftragsstatus befinden, können unter bestimmten Voraussetzungen noch gelöscht werden. Dies gilt auch für Match-Instruktionen. Löschungen sind jedoch nicht direkt im Auftragsstatus möglich. *Die Aufträge werden im Auftragsstatus nur markiert und damit in den Erfassungsstatus überführt***.** Dieses Verfahren ist notwendig, um auch für Löschungen im Auftragsstatus das Vier-Augen-Prinzip sicherzustellen. Löschungen können nur vom Eingeber vorgenommen werden.

Folgende Schritte laufen dabei ab:

1. Markierung des zu löschenden Auftrages im Auftragsstatus
2. Herausnahme des markierten Auftrages aus dem Auftragsstatus und Ablegen in die Historie des Auftragsstatus
3. Generierung des markierten Auftrages in den Erfassungsstatus
4. Kontrolle des zu löschenden Auftrages im Erfassungsstatus
5. Physische Löschung des kontrollierten Auftrages aus dem Erfassungsstatus

Die Markierung zur Löschung im Auftragsstatus ist nicht möglich für bereits bestätigte Match-Aufträge/Match-Instruktionen.

Die Rücknahme (Löschung) bereits bestätigter Aufträge ist nur möglich über den Funktionscode „RM" im Match-Dienst.

```
TRAN: KVAA FC:    SB: #####

AUFTRAGSABWICKLUNG      A E N D E R U N G / L O E S C H U N G    AUFTRAGSSTATUS


MA   MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR AENDERUNG

ML   MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR LOESCHUNG

AA   AENDERUNG EINES AUFTRAGES FUR PARTIAL
     SETTL.INDICATOR UND DISPO-PRIORITAET
                                              AUFTRAGS-NUMMER   : .........



LM   LOESCHEN MASCHINELL ERZEUGTER AUFTRAEGE
                                              AUFTRAGS-NUMMER   : .........
                                              AUFTRAGSURSPRUNG  : ...
                                              EINGEBER          : ....


-- ID-KZ: 7930000099 -- PW:          ------ B79304E4 -- 19/11/14 -- 17:27:58 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

*** „LM" kann nur von CBF genutzt werden, „AA" kann zurzZeit noch nicht genutzt werden

Um einen Auftrag zur Löschung markieren zu können, muss dessen Auftragsnummer bekannt sein. Der Benutzer steigt also mit dem Transaktionscode KVAA und dem Funktionscode "ML" sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erscheint die tabellarische Anzeige des ausgewählten Auftrages.

4.4.2.1.2 (B) Tabellarische Anzeige/Markierung zur Löschung

```
TRAN: KVAA FC: ML SB: 000107779

AUFTRAGSABWICKLUNG              AUFTRAEGE / MARKIERUNG           AUFTRAGSSTATUS

LAST-KTO: 7930 000                                                  SEITE   1


K M S D AA SA   AUFTNR GUT  WKN             NOMINALE            GEGENWERT SET-D

_   0 4 01 3    107779 7399 DE0009225401  20.354.980                    19.11









-- ID-KZ: 7930260009 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 09:52:46 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"I" = Selektion des Auftrages zur Vollanzeige

"X" = Markierung des Auftrages zur Löschung

4.4.2.1.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es kann nur ein Auftrag mit „I" oder „X" gekennzeichnet werden.

4.4.2.1.4 (D) Vollanzeige von Aufträgen/Information Auftragsstatus

Wird vor dem Auftrag im Feld KZ ein „I" eingegeben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller gespeicherten Daten dieses Auftrages, ggf. über mehrere Masken (bei bestimmten Auftragsarten).

Das Verzweigen in die Vollanzeige/Information kann notwendig werden, wenn die tabellarische Information nicht ausreicht und der Benutzer sich vergewissern will, dass er den richtigen Auftrag bearbeitet.

Mit PF3 kehrt man in die tabellarische Kurzanzeige zurück.

4.4.2.1.5 (E) Markierung zur Löschung

In der tabellarischen Kurzanzeige wird der Auftrag mit einem „X" zur Löschung markiert.

Nach Bestätigung der Markierung mit PF3 springt das System in das Menü der Änderung/Löschung zurück und gibt dort eine Verarbeitungsbestätigung aus.
Nach Bestätigung der Markierung mit PF3 springt das System in das Menü der Änderung/Löschung zurück und gibt dort eine Verarbeitungsbestätigung aus.

Der markierte Auftrag wird mit dem internen Status "Auftrag zur Löschung markiert, nicht mehr zur Verarbeitung heranziehen" versehen. Außerdem werden Datum, Uhrzeit, Terminal und User-ID der Markierung festgehalten. Der Auftrag ist im Informationsdienst des Auftragsstatus als historischer Auftrag abrufbar.

Anschließend wird der markierte Auftrag in den Erfassungsstatus des Eingebers generiert. Dort läuft dieser Auftrag dann direkt in die Kontrolle. Nach erfolgter Kontrolle wird dieser Auftrag physisch aus dem Erfassungsstatus gelöscht.

4.4.3 Information zum Auftragsstatus (AI)

4.4.3.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Im Informationsdienst für die im CASCADE Auftragsstatus befindlichen Aufträge können sich die Kunden über Aufträge informieren,

die sie selbst in den CASCADE-Auftragsstatus eingestellt haben sowie

die von der Kontrahentenseite eingegeben wurden.

Die Informationsabfrage bietet darüber hinaus folgende Möglichkeiten:

- Kurzanzeige von Aufträgen aufgrund der angegebenen Auswahlkriterien,
- Vollanzeige eines Auftrages mit ausführlicher Statusanzeige bezüglich Matching, Settlement und Disposition,
- Online-Druck eines Auftrages mit allen Informationen.

Es ist zu unterscheiden zwischen *aktuellen* und *historischen* Aufträgen:

4.4.3.1.2 (B) Information Hauptauswahl Auftragsstatus

```
TRAN: KVAI FC:    SB: ######I####

AUFTRAGSABWICKLUNG             I N F O R M A T I O N             AUFTRAGSSTATUS

AA   AUFTRAGSART         : ..                KZ-AA: .
AN   AUFTRAGS-NUMMER     : .........
AD   NICHT ERFOLGREICH DISPONIERTE AUFTRAEGE


MA   MATCH-AUFTRAEGE     : .  M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)
MI   MATCH-INSTRUKTIONEN : .  M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)

SS   SDS-AUFTRAEGE (SOFORTDISPOSITION)
SR   RTS-AUFTRAEGE (SOFORTDISPOSITION)

ZUSAETZLICHE      LASTSCHRIFT-BANK : ....    WKN            : I ............
AUSWAHL           GUTSCHRIFT-BANK  : ....    SETTLEMENT-DAY : ..........
                                             WRG GEGENWERT  : ...

HA   HISTORISCHE AUFTRAEGE                   EINGEBER       : ....

-- ID-KZ: 7930000099 -- PW:          ------ B79304E4 -- 19/11/14 -- 17:30:12 --

PF1:Hilfe  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Mögliche Funktionscodes für aktuelle Aufträge:

Aktuelle Aufträge sind gültig an CBF erteilte Aufträge im Auftragsstatus. Diese Aufträge können anhand folgender Kriterien selektiert werden:

Funktionscode	Funktion	Eingaben
AA	Alle Aufträge einer Auftragsart (nach Betätigen der PF1-Taste werden die möglichen Auftragsarten angezeigt)	*wenn AA = 01 oder 02* LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • LAST-BANK und GUT-BANK auch beide möglich (optional) *** • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY (optional) • WRG (optional)**** *wenn AA = 01* zusätzliche Auswahl möglich KZ AA: • Art eines WP-Übertrages A = CCP-Auftrag B = Bestandsübertrag RS E = Emissionseinführung RS P = Depotübertrag RS W = WP-Übertrag *wenn AA 02* zusätzliche Auswahl möglich KZ AA: • Art einer Match-Instruktion A = CCP-Instruktion E = Emissionseinführung RS W = WP-Übertrag *wenn AA = 03:* • entweder LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • LAST-BANK und GUT-BANK auch beide möglich (optional)*** • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY (optional) *wenn AA = 07 oder 09:* • LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • LAST-BANK und GUT-BANK auch beide möglich (optional) ** • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY (optional)*

Funktionscode	Funktion	Eingaben
AA		*wenn AA = 14 oder 15* • LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • LAST-BANK oder GUT-BANK auch beide möglich (optional)** • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY (optional)
		wenn AA = 16 zusätzliche Auswahl möglich KZ AA (Kennzeichen Auftragsart): • Art einer Einlieferung L = laufende Einlieferung von Einzelurkunden und techn. Sammelurkunden N = Neuzulassung/Aufstockung von Globalurkunden/Jungscheinen V = Valutierung von BIS-ZU Globalurkunden *wenn AA = 17 oder 19:* • LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • LAST-BANK und GUT-BANK auch beide möglich (optional) ** • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY (optional) *wenn AA = 18* zusätzliche Auswahl möglich KZ AA (Kennzeichen Auftragsart): • Art einer Einlieferung A = laufende Auslieferung von Einzelurkunden und techn. Sammelurkunden R = Auslieferung Rahmenurkunde S = Auslieferung stückeloser Werte

**** durch Auswahl „XXX“ im Feld „WRG GEGENWERT“ können ausschließlich Settlement Instruktionen ohne Gegenwert angezeigt werden, durch die Auswahl „YYY“ ist es möglich, sich ausschließlich Settlement Instruktionen mit Gegenwert in einer der zulässigen Fremdwährungen anzeigen zu lassen. Die Sortierfolge der Anzeige richtet sich hierbei zuerst nach der ISIN und dann nach aufsteigender Nominale.

*** wenn die Felder LAST-BANK und GUT-BANK entsprechend gefüllt sind, werden Ihnen im Informationsdienst auch Aufträge der Kontrahentenseite angezeigt

** das Gegenkonto entspricht jeweils einem internen Abwicklungskonto der CBF

* bei AA 07 entspricht der Set-Day bis zur Freigabe durch die CBF dem Erfassungstag

Zur Eingabe des zweistelligen Kürzels der Auftragsart bei dem Funktionscode AA kann der Benutzer die PF1-Taste drücken. Ihm wird dann zwei Masken mit den möglichen Auftragsarten, getrennt nach Giro- und

Wertebereich, angezeigt:

4.4.3.1.3 (B1) Hilfemasken zur Erklärung für Funktionscodes AA

```
TRAN: KVAI FC:    SB: ######I####

AUFTRAGSABWICKLUNG         ERKLAERUNG FUER FUNKTIONSCODE AA      AUFTRAGSSTATUS

            ANZEIGE DER MOEGLICHEN AUFTRAGSARTEN --GIROBEREICH--

  01  WP-UEBERTRAG                          03  BSV/LSV-UEBERTRAG
      KZ-AA = A - CCP-AUFTRAG                04  VERPFAENDUNG
            = C - XEMAC-AUFTRAG              05  FREIGABE
            = E - EMISSIONSEINF. RS          07  GBC-UMTAUSCH
            = P - DEPOTUEBERTRAG RS          09  GBC-RUECKTAUSCH
            = B - BESTANDSUEBERTRAG RS       11  WP-LEIHAUFTRAG
            = W - OHNE KZ-AA ARTEN           12  WP-LEIHE/RUECKFUEHRUNG
            = L - ALLEGEMENT                 13  KADI NON-INCOME
            = I - REALIGNMENT                14  BOND-STRIPPING:AUFTEILUNG
  02  MATCH-INSTRUKTION                      15  BOND-STRIPPING:ZUSAMMENFUEHRUNG
      KZ-AA = A - CCP-INSTRUKTION            17  OPTIONSSCHEINTRENNUNG
            = E - EMISSIONSEINF. RS          19  OPTIONSSCHEINZUSAMMENFUEHRUNG
            = W - OHNE KZ-AA ARTEN           99  STORNO/NACHBUCHUNG DEPOTUMSATZ
            = L - ALLEGEMENT

-- ID-KZ: 7930000099 -- PW:          ------ B79304E4 -- 19/11/14 -- 17:32:58 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Folgemaske Wertebereich:

```
TRAN: KVAI FC:    SB: ######I####

AUFTRAGSABWICKLUNG         ERKLAERUNG FUER FUNKTIONSCODE AA      AUFTRAGSSTATUS

              ANZEIGE DER MOEGLICHEN AUFTRAGSARTEN --WERTEBEREICH--
  16  EINLIEFERUNG
      KZ-AA
        L                  LFD. EINLIEFERUNG
        N                  NEUZULASSUNG SAMMELURKUNDE
        V                  VALUTIERUNG
        E                  NEUZULASSUNG SAMMELURKUNDE EDT
        F                  EINLIEFERUNG FREMDTRESOR
        B                  EINLIEFERUNG SONDERVERWAHRUNG
        M                  EINLIEFERUNG EDELMETALL









-- ID-KZ: 7930000099 -- PW:          ------ B79304E4 -- 19/11/14 -- 17:33:12 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

Weitere Folgemaske Wertebereich:

```
TRAN: KVAI FC:    SB: ######I####

 AUFTRAGSABWICKLUNG         ERKLAERUNG FUER FUNKTIONSCODE AA      AUFTRAGSSTATUS

               ANZEIGE DER MOEGLICHEN AUFTRAGSARTEN --WERTEBEREICH--
   18  AUSLIEFERUNG
       KZ-AA
         A                  LFD. AUSLIEFERUNG
         R                  RAHMENURKUNDE / TEILREDUZIERUNG
         S                  GLOBALURKUNDE
         F                  AUSLIEFERUNG FREMDTRESOR
         M                  EDELMETALL
         B                  SONDERVERWAHRUNG









 -- ID-KZ: 7999000099 -- PW:          ------ B79994E4 -- 19/11/14 -- 17:33:47 --

 PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

Funktionscode	Funktion	Eingaben
AN	der Einzelauftrag mit der eingegebenen Auftragsnummer (es können nur *eigene* Aufträge angeschaut werden.	• LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • SETTLEMENT-DAY (optional) • WKN (optional) • WRG GEGENWERT (optional)
AD	alle nicht disponierten Aufträge	• LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • WKN (optional) • WRG GEGENWERT (optional)
MA	alle Match-Aufträge	• wenn „M", „O" oder „F" nicht eingegeben wird, erfolgt eine Anzeige aller matchpflichtigen Aufträge • LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY (optional) • WRG GEGENWERT (optional)
MI	alle Match-Instruktionen	• wenn „M", „O" oder „F" nicht eingegeben wird, erfolgt eine Anzeige aller Match-Instruktionen • LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY (optional) • WRG GEGENWERT (optional)
SS	Alle Aufträge aus der Sofortdisposition	• LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY = Tagesdatum (wird automatisch ergänzt) • WRG GEGENWERT (optional)
SR	Alle Aufträge aus der Sofortdisposition	• LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY = Tagesdatum (wird automatisch ergänzt) • WRG GEGENWERT (optional)

Hinweis:

Match-Instruktionen sind nur über den Funktionscode „MI" oder „AA" mit Angabe der entsprechenden Auftragsart zu erreichen. Bei allen anderen Einstiegen werden nur Aufträge angezeigt.

Die Zentrale einer Bank kann sich durch Eingabe der Niederlassungs-Kontonummern auch die im Auftragsstatus vorhandenen Niederlassungs-Aufträge angezeigten lassen. Die Bank muss allerdings als

Reg-Über-Teilnehmer bei der Clearstream Banking AG zugelassen sein.

Mögliche Funktionscodes für historische Aufträge:

Soll ein aktueller Auftrag geändert oder gelöscht werden, so wird dieser im Auftragsstatus markiert und damit in den Erfassungsstatus überführt. Dadurch wird der Auftrag im Auftragsstatus ungültig. Gleichzeitig wird er als historischer Auftrag in seinem vollen Umfang und mit allen Statusausprägungen, die er zum Zeitpunkt der Markierung hatte, abgelegt.

Funktionscode	Funktion	Eingaben
HA	Anzeige aller historischen Aufträge, die am Tagesdatum abgelegt wurden	- Zusätzliche Eingaben sind nicht erlaubt

Hinweis: Die historische Anzeige erfolgt über alle Auftragsarten.

4.4.3.2 Aktuelle Aufträge mit Auswahl Währung Gegenwert

4.4.3.2.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Die Maske der tabellarischen Kurzanzeige ist für alle Funktionscodes gleich. Hier werden alle selektierten Aufträge mit den *buchungsrelevanten Feldern* angezeigt. Zusätzlich werden Informationen bezüglich Match-Status („M"), Settlement-Status („S") und Dispositions-Status („D") eines Auftrages angezeigt (vgl. dazu die Feldbeschreibungen im Kapitel „Hinweis"). Als weiteres Auswahlkriterium wurde die Währung Gegenwert mit EUR gewählt.

Hinweis:

Wenn das Feld WRG GEGENWERT in der Auswahlmaske nicht gefüllt wird, wird keine Summenzeile ausgegeben, da für die angezeigten Aufträge Gegenwerte in unterschiedlichen Währungen existieren können.

Bei Umtauschaufträgen (AA 07), die von Seiten der Clearstream Banking AG noch nicht zur Disposition und Buchung freigegeben worden sind, wird der Settlement-Status („S") mit der Ausprägung „01" (gesperrt durch den Auftraggeber) belegt und angezeigt.

4.4.3.2.2 (B) Tabellarische Anzeige/Information im Auftragsstatus

```
TRAN: KVAI FC: AA SB: 01##7931#I###19.11.2014#

 AUFTRAGSABWICKLUNG              AUFTRAEGE / INFORMATION          AUFTRAGSSTATUS

 LAST-BANK: 7931                    WRG GEGENWERT:                      SEITE   1

 K M S D AA RTS  AUFTNR GUT  WKN             NOMINALE            GEGENWERT SET-D

 _ 1 0 4 01 N       500 4567 DE0005758650         500            10.000,00 19.11
 _ 1 0 4 01 N       504 3456 DE0005758650       5.000            40.000,00 19.11
   1 0 4 01 N       106 6789 DE0005878003       1.000           100.000,00 19.11
 _ 1 0 4 01 N       100 5678 DE0005878003       5.000            60.000,00 19.11
 _ 1 1 4 01 N   2040002 3456 DE0006283302       1.000            12.000,00 19.11
 I 2 0 4 01 N    449311 7930 DE0008032004       4.000            40.000,00 19.11
 _   1 4 01     2040006 4567 DE0008404005           1                      19.11
     1 4 01     2040008 5678 DE0008404005           1                      19.11
 _   1 4 01     2040010 3456 DE0008404005           1                      19.11


 GESAMTSUMMEN  ANZAHL AUFTRAEGE:      9        16.503

 -- ID-KZ: 7931260001 -- PW:          ------ B79313FX -- 19/11/14 -- 11:21:33 --

 PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I" = Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

„D" = Druck aller Daten des selektierten Auftrages nach Betätigung der Taste PF2

4.4.3.2.3 (C) Vollanzeige/Information im Auftragsstatus

Mit der Eingabe „I" wird in die Einzelanzeige eines WP-Übertrages wie folgt verzweigt:

```
TRAN: KVAI FC: AA SB: 01###I##7931#19.11.2014#

AUFTRAGSABWICKLUNG     WP-UEBERTRAG / INFORMATION                AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR   :    449311

LAST     : 7931 000       HANDELSBANK AG                      / BANKDEFFXXX
GUT      : 7930 000       TESTBANK AG                         / TESTDEFFXXX
WKN      : I DE0008032004 COMMERZBANK AG O.N.

NOMINALE :             4.000       EINHEIT: ST        DISPO-PRIORITAET: 4 MST
GEGENWERT:          40.000,00      WRG    : EUR       VWA       : GS  SVG
DCA/REF  :                                            EMISS-EINF: N
SET-DAY  : 19.11.2014              EX-TRD :           BATM/ADEA : N
BOERSENPL:                         OPT-OUT:           RTS-DVP   : N

MATCH-STATUS   : 02 AUFTRAG BESTAETIGT MIT GEGENAUFTRAG NUMMER 0000013
PRTYHLD-STATUS :  0 AUFTRAG ZUR DISPOSITION FREIGEGEBEN
DISPO-STATUS   :  4 ABGELEHNT, GELD NICHT AUSREICHEND


-- ID-KZ: 7931260001 -- PW:          ------ B79313FX -- 19/11/14 -- 11:01:39 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF8:Vor
```

```
TRAN: KVAI FC: AA SB: 01###I##7931#19.11.2014#

AUFTRAGSABWICKLUNG       WP-UEBERTRAG / INFORMATION-2            AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR:    449311       WKN: I DE0008032004

T2S ACTOR BIC:                     T2S ACTOR REF    :
                                   MITI REF         :
REFERENZ-NR  :                     AUFTRAGS-REFERENZ:
ALREADY MATCHED      :             PARTIAL SETTL IND:
ISO TRANSACTION CODE :             REASON CODE      :

SCHLUSSTAG   : 19.11.2014          KURS / WRG       :
EXT SET-DAY  :                     GEGEN-AUFTNR     :
UEB-GRUND    :
URSPR-NOM    :                     RUECKUEBERTRAG   : N         TR:
BELEGSCHAFTS-SP: N                 SP-DATUM         :
KUPONINFO/RECORD-DATE:


TEXT:
-- ID-KZ: 7931260001 -- PW:          ------ B79313FX -- 19/11/14 -- 11:12:06 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

In den Feldern T2S ACTOR BIC, T2S ACTOR REF, MITI REF, ALREADY MATCHED, PARTIAL SETTL IND, ISO TRANSACTION CODE und REASON CODE werden zurzeit noch keine Daten angezeigt.

```
TRAN: KVAI FC: AA SB: 01###I##7931#19.11.2014#

AUFTRAGSABWICKLUNG        WP-UEBERTRAG / FOLGEINFORMATION        AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR:    449311       WKN: I DE0008032004

SETTL PARTY - LIEFERER
P1:
P2:
P3:
P4:
P5:

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1:
P2:
P3:
P4:
P5:


-- ID-KZ: 7931260001 -- PW:          ------ B79313FX -- 19/11/14 -- 11:12:28 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF7:Zurück
```

Mit Betätigung der Taste PF5 wird die Maske „Status-Information“ angezeigt:

```
TRAN: KVAI FC: AA SB: 01###I##7931#19.11.2014#

AUFTRAGSABWICKLUNG       WP-UEBERTRAG / STATUS-INFORMATION       AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR:    449311      WKN: I DE0008032004

STATUSART           AKT.      BESCHREIBUNG              BEANTR  BEARBEITUNGS
                    STATUS                              STATUS     STATUS
PARTY HOLD-STATUS : 0     FREIGEGEBEN
LOESCH-STATUS     : 0     KEINE LOESCHANFRAGE
DISPO-PRIORITAET  : 4     NORMALE PRIORITAET
PARTIAL SETTL IND :


CSD HOLD-STATUS   : 0     FREIGEGEBEN
CSD VALHOLD-STATUS: 0     FREIGEGEBEN
          RULE-ID :
CoSD HOLD-STATUS  : 0     FREIGEGEBEN
          RULE-ID1:
          RULE-ID2:

-- ID-KZ: 7907260001 -- PW:          ------ B99980J0 -- 19/11/14 -- 14:00:25 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Die Maske wird zurzeit wie folgt genutzt:

Feldname	Beschreibung
AKT.STATUS	Zeigt den gegenwärtigen Wert/Status
BESCHREIBUNG	Kurze Beschreibung des gegenwärtigen Wertes/Status
BEANTR STATUS	Dieses Feld wird zurzeit noch nicht verwendet.
BEARBEITUNGS STATUS	Dieses Feld wird zurzeit noch nicht verwendet.
PARTY HOLD-STATUS	Identisch mit dem Status in Maske 1
LOESCH-STATUS	Für innerdeutsche Geschäfte wird „0 KEINE LOESCHANFRAGE" angezeigt
DISPO-PRIORITAET	Identische mit der Priorität in Maske 1
PARTIAL SETTL IND	Dieses Feld wird zurzeit noch nicht verwendet.
CSD HOLD-STATUS	Standardanzeige „0 FREIGEGEBEN"
CSD VALHOLD-STATUS	Standardanzeige „0 FREIGEGEBEN"
CoSD HOLD-STATUS	Standardanzeige „0 FREIGEGEBEN"
RULE-ID	Dieses Feld wird zurzeit noch nicht verwendet.
RULE-ID1	Dieses Feld wird zurzeit noch nicht verwendet.
RULE-ID2	Dieses Feld wird zurzeit noch nicht verwendet.

Historische Aufträge

Auf der Kurzanzeige werden alle historischen Aufträge, die der Teilnehmer selbst zum Ändern oder Löschen markiert hat, in Kurzform angezeigt.

```
TRAN: KVAI FC: HA SB:

 AUFTRAGSABWICKLUNG              AUFTRAEGE / INFORMATION          AUFTRAGSSTATUS

 HISTORISCHE AUFTRAEGE                                                 SEITE   7

 K AA    AUFTNR LAST-KTO  GUT-KTO  WKN             NOMINALE            GEGENWERT

   01   9393627 6789 000  6789 491 CH0011075394         150
 _ 01   9393632 6789 000  6789 491 CH0011075394         150
 _ 01   9393638 6789 000  6789 491 CH0011075394         150
 _ 01   9393640 6789 000  6789 491 CH0011075394         150
 _ 01   9393569 6789 491  6789 000 CH0012221716       1.000
   01   9393582 6789 491  6789 000 CH0012221716       1.000
 _ 01   9393600 6789 491  6789 000 CH0012221716       1.000
 _ 01   9393615 6789 491  6789 000 CH0012221716       1.000
   01   9393630 6789 491  6789 000 CH0012221716       1.000
 _ 01       112 7931 000  7930 000 DE000A0Z17A1       5.000
 _ 02       212 7931 000  7930 000 DE000A0Z17A1       5.000
 i 01       113 7931 000  7930 000 DE000A0Z17A1      15.000

 -- ID-KZ: 7931260001 -- PW:          ------ B79313FX -- 19/11/14 -- 11:44:05 --

 PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I" = Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

„D" = Druck aller Daten des selektierten Auftrages nach Betätigung der Taste PF2

4.4.3.2.4 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Der Benutzer kann nur einen Auftrag für die Vollanzeige auswählen, d. h. er darf in der Spalte KZ nur *ein "I"* eingeben. Außerdem darf "I" nicht mit der Eingabe eines "D" kombiniert werden. Die Markierung mehrerer Aufträge mit dem Kennzeichen "D" ist zulässig.

4.4.3.2.5 (D) Vollanzeige von Aufträgen/Information Auftragsstatus

Wird vor einem Auftrag das Feld KZ mit „I" überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller erfassten Felder, über mehrere Masken.

```
TRAN: KVAI FC: HA SB:

 AUFTRAGSABWICKLUNG     WP-UEBERTRAG / INFORMATION                AUFTRAGSSTATUS

 AUFTNR   :       113                                  ID LOESCHUNG: 7907260001

 LAST     : 7931 000       HANDELSBANK AG                       / BANKDEFFXXX
 GUT      : 7930 000       TESTBANK AG                          / TESTDEFFXXX
 WKN      : I DE000A0Z17A1 6 % BIOFRONTERA OPA.09/17 OO 31.12.G

 NOMINALE :            15.000       EINHEIT: EO         DISPO-PRIORITAET: 4 MST
 GEGENWERT:                         WRG    :            VWA       : GS  GS
 DCA/REF  :                                             EMISS-EINF: N
 SET-DAY  : 19.11.2014              EX-TRD :            BATM/ADEA : N
 BOERSENPL:                         OPT-OUT:            RTS-DVP   : N

 MATCH-STATUS   : 01 MATCHING OFFEN; KEINEN GEGENAUFTRAG GEFUNDEN
 PRTYHLD-STATUS :  0 AUFTRAG ZUR DISPOSITION FREIGEGEBEN
 DISPO-STATUS   :  4 ABGELEHNT, GEGENSEITE FEHLT



 -- ID-KZ: 7931260001 -- PW:          ------ B79313FX -- 19/11/14 -- 11:45:59 --

 PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Aktuelle Aufträge

Zusätzlich zu den im Erfassungsstatus eingegebenen Daten werden im Auftragsstatus Informationen bzgl. Settlement- und Dispositionsstatus sowie ggfs. Match-, Lösch- oder CSD-Fremdstatus eines Auftrages angezeigt.

Historische Aufträge

Bei der Vollanzeige eines als historisch abgelegten Auftrages wird darüber hinaus der Hinweis „ID AENDERUNG" oder „ID LOESCHUNG" und die User-ID des für die Markierung des Auftrages verantwortlichen Teilnehmers angezeigt.

Von der Vollanzeige aus kann mittels PF2 ein *Online-Druck* des angezeigten Auftrages erfolgen. Wenn die Vollanzeige sich über mehrere Masken erstreckt, werden alle Masken ausgedruckt, unabhängig davon, in welcher Maske der Online-Druck initiiert wurde.

Dieser Online-Druck ist sowohl für aktuelle Aufträge als auch für historische Aufträge möglich.

Neben den angezeigten Daten enthält die ausgedruckte Liste auch User-ID, Datum und Uhrzeit der Kontrolle und ggf. der Änderung oder Löschung.

Beim Online-Druck eines WP-Übertrages mit und/ohne Gegenwert, der bereits bestätigt (="matched") wurde, wird der Zeitpunkt des Matchings ebenfalls auf der Liste ausgewiesen.

4.5 Matching

Wertpapier-Überträge mit und ohne Gegenwert (Match-Auftrag) sind vom Empfänger der Lieferung in Form einer Match-Instruktion zu bestätigen, unabhängig davon welche Auftragsseite zuerst in das CASCADE-System eingestellt wird. Nur WP-Überträge mit dem Status „matched" können per Settlement-Day zur Disposition weitergeleitet werden. Das Matching findet direkt statt, wenn ein erfasster und kontrollierter Wertpapier-Übertrag bzw. eine Match-Instruktion (per File Transfer, IBM WebSphere MQSeries, SWIFT) erteilte Aufträge gelten als kontrolliert) in den Auftragsstatus gelangen.

Das Matching erfolgt in CASCADE anhand von Haupt-Matchkriterien und optionalen Matchkriterien nach der Kontrolle eines erfassten Auftrags.

Haupt-Matchkriterien:

- Lastschrift-Bank (übertragende Bank)
- Gutschrift-Bank (empfangende Bank)
- Wertpapierkennung
- Nennwert/Nominale
- Gegenwert
- Währung
- Settlementtag
- Party 1 in Settlement Party – Empfänger nur bei Crossborder-Geschäften CSD/(I)CSD auf der Gut-Seite siehe Kapitel 4.5.1
- Party 1 in Settlement Party – Lieferer nur bei Crossborder-Geschäften CSD/(I)CSD auf der Last-Seite siehe Kapitel 4.5.1
- Schlusstag (Handelstag)
- RTS DVP in Euro (J/N)

Optionale Matchkriterien:

- Emissionseinführung (nur bei Namensaktien)
- Gegen-Auftragsnummer (nur für Direct Matching)

Die Haupt-Matchkriterien dienen als Suchkriterien bei der Auffindung des Gegenauftrags. Wird der Gegenauftrag gefunden, werden auch die optionalen Matchkriterien abgeglichen, sofern sie in beiden Aufträgen enthalten sind. Nur wenn sowohl die Haupt-Matchkriterien als auch die optionalen Matchkriterien übereinstimmen, gilt der Auftrag als „matched". Für den Abgleich des Gegenwertes bei Wertpapierüberträgen gegen Zahlung gelten Toleranzgrenzen (siehe nachfolgenden Abschnitt). Weichen beide Gegenwerte im Rahmen der zulässigen Toleranzgrenze voneinander ab, so wird in den STD- und SDS-Verarbeitungen für die Geldregulierung der Gegenwert aus dem Lieferauftrag des Auftraggebers (Verkäufers) herangezogen. Die RTS-Verarbeitung reguliert bei abweichenden Gegenwerten mit dem Gegenwert aus dem Match-Auftrag des Empfängers (Käufers).

4.5.1 Erweiterte Kriterien zum Matching

Für die Matchkriterien „Settlement Party – Lieferer: Party 1" und „Settlement Party – Empfänger: Party 1" sind bei CSD/(I)CSD-Cross-Border-Übertragungen folgende weitere Kriterien zu beachten:

Aufträge zugunsten eines CSD/(I)CSD Kontos:

- Settlement Party – Lieferer: Party 1 = Kannfeld und damit kein Haupt-Matchkriterium
- Settlement Party – Empfänger: Party 1 = Mussfeld und damit Matchkriterium.

Aufträge zulasten eines CSD/(I)CSD Kontos:

- Settlement Party – Lieferer: Party 1 = Mussfeld und damit Matchkriterium
- Settlement Party – Empfänger: Party 1 = Kannfeld und damit kein Haupt-Matchkriterium.

4.5.2 Verarbeitung Matching

Die Verarbeitung Matching für WP-Übertrag/Match-Instruktion sowie aktiv eingestellte Match-Instruktionen ohne Gegenwertverrechnung besteht also aus folgenden Schritten:

- Suchen Gegenauftrag mit den Haupt-Matchkriterien
- Prüfen der optionalen Matchkriterien
- Setzen Match-Status.

Das Resultat von Suchlauf und Abgleich wird im Match-Status des verarbeiteten Auftrages festgehalten und ist im Informationsdienst des Auftragsstatus ersichtlich. Folgende Ausprägungen zum Match-Status können als Ergebnis der Verarbeitung Matching auftreten:

- Matching offen, kein Gegenauftrag mit übereinstimmenden Matchkriterien gefunden.
  Mögliche Gründe:
  - Es ist noch kein Gegenauftrag erfasst und an CASCADE übertragen worden.
  - Ein vorhandener Gegenauftrag hat abweichende Matchkriterien
  - Ein vorhandener Gegenauftrag hat die Gegenauftragsnummer für Direct Matching befüllt.
- Matching offen, es handelt sich um eine alternative Match-Position, d. h. es existieren mehrere gleiche Gegenaufträge, die mit „*" gekennzeichnet werden. Der Auftrag mit dem ältesten Erfassungsdatum wird zur Matchbestätigung herangezogen.
- Auftrag bestätigt mit Gegenauftrag Nummer. Gegenauftrag mit übereinstimmenden Matchkriterien gefunden. In diesem Fall erhalten WP-Übertrag und Match-Instruktion diesen Status.
- Rücknahme Matching durch den Begünstigten.
- Rücknahme Matching durch den Auftraggeber.

Der Benutzer kann sich im Informationsdienst über das Ergebnis der Verarbeitung informieren.

4.5.3 Direct Matching

Die CASCADE-Auftragsarten WP-Übertrag und Match-Instruktion mit und ohne Gegenwert (AA01/AA02) können über ein weiteres optionales Eingabefeld einem direkten Matching zugeführt werden. Wird ein gezieltes Matching zu einer bereits in CASCADE vorhandenen Gegeninstruktion gewünscht, kann das Feld „GEGEN-AUFTNR" befüllt werden. Diese zusätzliche optionale Eingabe der Gegen-Auftragsnummer von beiden Auftragsseiten dient der direkten Matching Verarbeitung und somit können Cross-Matching-Fehler verhindert werden. Wird kein Gegenauftrag mit der ergänzenden Information gefunden, bleibt der Auftrag im Status „Matching offen". Nach einer eventuellen Matching Rücknahme eines solchen Auftrages mit Direct Matching wird das Feld „GEGEN-AUFTNR" gelöscht; der Auftrag kann dann erneut mit einem entsprechenden Gegenauftrag gematched werden.

4.5.4 Zusätzliche Kriterien für Matching

4.5.4.1 Gegenwert – Toleranzen für Wertpapierübertrag mit Gegenwert

Folgende Gegenwert Toleranzen je zugelassener Abrechnungswährung sind festgelegt und zusätzlich online über den Transaktionscode „KVAV" mit Funktionscode „IW" abrufbar:

WHR	Bezeichnung	Währungsraum	Toleranzbetrag je Währung für Matching mit Gegenwert
AUD	Australische Dollar	Australien	30,-
CAD	Kanadische Dollar	Kanada	35,-
CHF	Schweizer Franken	Schweiz	25,-
CNY	Chinesischer Renminbi	China	200,-
CZK	Tschechische Kronen	Tschechien	900,-
DKK	Dänische Kronen	Dänemark	175,-
EUR	Euro	Europäischer Währungsraum	25,-
GBP	Pfund Sterling	Großbritannien	15,-
HKD	Hongkong Dollar	Hongkong	280,-
HUF	Ungarische Forint	Ungarn	6.600,-
JPY	Japanische Yen	Japan	3.500,-
MXN	Mexikanische Peso	Mexiko	200,-
NOK	Norwegische Kronen	Norwegen	180,-
NZD	Neuseeländische Dollar	Neuseeland	35,-
PLN	Polnische Zloty	Polen	100,-
SEK	Schwedische Kronen	Schweden	200,-
RUB	Russische Rubel	Russland	1.000,-
TRY	Neue Türkische Lira	Türkei	35,-
SGD	Singapur Dollar	Singapur	50,-
USD	US-Dollar	USA	25,-
ZAR	Südafrikanische Rand	Südafrika	120,-

4.5.4.2 Ausnahmen – Matching Wertpapierauftrag ohne Gegenwert

CASCADE bietet verschiedene Auftragsarten zur Erteilung von Wertpapierauftrag ohne Gegenwert (D-FoP). Vom FoP Matching, Eingabe eines entsprechenden Wertpapiererhalt Auftrages ohne Gegenwert (R-FoP) sind nicht alle Wertpapierüberträge dieser Auftragsart betroffen.

Nachfolgend sind die Typen von Wertpapierüberträgen ohne Gegenwert aufgeführt, die der Match-Pflicht unterliegen:

- Wertpapierübertrag ohne Gegenwert (gilt sowohl für D-FoP-Instruktionen mit Inhaberpapieren als auch für D-FoP-Instruktionen mit Namensaktien (RS), die im freien Meldebestand übertragen werden, CCP surplus deliveries ; CASCADE-Auftragsart 01)
- Emissionseinführung RS ohne Gegenwert, (CASCADE-Auftragsart 01).

Die Matchpflicht der D-FoP-Instruktion hängt dabei von der Konstellation der beteiligten CBF-Konten ab.

Die nachfolgende Tabelle gibt einen allgemeinen und beispielhaften Überblick über matchpflichtige CBF-Konten. Gerne lassen wir Ihnen eine individuelle Aufstellung Ihrer matchpflichtigen CBF-Konten zukommen (siehe hierzu Kapitel , Liste aller matchpflichtigen CBF-Konten erhältlich).

Kontenbezeichnung	Kontonummer[1)]
Kundenkonto	XXXX 000, XXXX 901-906, XXXX 061-062 (u.a.)
Kundenkonto/Makler	XXXX 000
Nicht verkaufte Werte	XXXX 410
Eurex Bonds, Equity CCP	7525 000 und 8501 000
Kundenkonto Haussammelverwahrung	XXXX 001
Edelmetalle (Deutsche Börse Commodities GmbH)	7332 000
Eigenbestand	XXXX 097
Fremdbestand	XXXX 096
TEFRA D Leadmananger (nur Überträge an Dritte)	XXXX 670

[1)] CBF nutzt zur Bestimmung der Matchpflicht eines CBF-Kontos einen CBF-internen technischen Schlüssel. Da dieser nicht eindeutig den verschiedenen CBF-Kontonummern zugeordnet werden kann, sind in der Tabelle nur exemplarisch die häufigsten Ausprägungen genannt. Der Platzhalter XXXX entspricht dem vierstelligen CBF-Kontostamm.

Für D-FoP-Instruktionen gilt die Match-Pflicht auch für CBF-Konten zwischen Zentralen und deren Niederlassungen oder CBF-Kunden, die mehrere CBF-Kontostämme unterhalten, da hier verschiedene rechtliche Entitäten involviert sein können.

Die Match-Pflicht von D-FoP-Instruktionen hängt einerseits ab von der Match-Pflicht des im Auftrag angegebenen Last- und/oder Gut-Kontos und andererseits davon, ob es sich bei dem Wertpapierübertrag um eine D-FoP-Instruktion innerhalb eines Institutes (gleicher Kontostamm) oder einem Wertpapierübertrag zwischen zwei unterschiedlichen Instituten (unterschiedliche Kontostämme) handelt.

Generell definiert folgende Logik die Match-Pflicht einer D-FoP-Instruktion:

Handelt es sich um eine D-FoP-Instruktion innerhalb desselben Institutes (gleicher CBF-Kontostamm), muss dieser nur dann gematcht werden, wenn beide daran beteiligten Konten matchpflichtig sind

Handelt es sich um eine D-FoP-Instruktion zwischen zwei verschiedenen Instituten (unterschiedliche CBF-Kontostämme), muss dieser dann gematcht werden, wenn das darin angegebene GUT-Konto (Empfängerkonto der Wertpapiere) matchpflichtig ist.

4.5.4.3 Keine FoP Match-Pflicht

Sobald ein CBF-Konto in einer D-FoP-Instruktion enthalten ist, das technisch dafür aufgesetzt ist, EUREX, EEX- oder Treuhand-Sicherheiten zu verwahren, gilt keine Matchpflicht. Dasselbe gilt für die CBF-Konten 7399 000 und 7299 000 (beide lautend auf „Clearstream Banking"):

Beispiele für diese CBF-Konten:

- EUREX-Sicherheiten: XXXX 500; XXXX 501
- EEX-Sicherheiten: XXXX 501; XXXX 502
- Treuhand-Sicherheiten: 7695 XX1 und 7697 XX1

4.5.4.4 Aktiv – Passiv Matching für FoP

Das FoP Matching wird unterstützt durch die beiden FoP Matching Dienste Aktiv- und Passiv-Matching. Der Kunde entscheidet für jedes seiner matchpflichtigen siebenstelligen CBF-Konten, welcher der beiden Dienste angewendet werden soll. Kunden erteilen CBF die Weisung zum Aktiv- und Passiv-Matching per Formular.

Kunden, die sich für Aktiv-Matching entscheiden, müssen dabei für matchpflichtige D-FoP-Instruktionen, bei denen sie als Empfänger der Wertpapiere (CASCADE: GUT) genannt sind, jeweils selbst die zugehörige R-FoP-Instruktion in CASCADE einstellen.

Für Kunden, die sich für Passiv-Matching entscheiden, generiert CBF bei Eingang einer matchpflichtigen D-FoP-Instruktion, bei dem diese Kunden als Empfänger der Wertpapiere (CASCADE: GUT) genannt sind, automatisch im Anschluss die zugehörige R-FoP-Instruktion. Dabei findet unmittelbar danach das Matching der beiden Instruktionen statt. Passiv-Matching wird ebenfalls auf Ebene des siebenstelligen CBF-Kontos beauftragt, so dass es möglich sein wird, diese Dienstleistung auch für definierte Unterkonten zu wählen.

Retail- und Wholesale FoP

Darüber hinaus ist es möglich, Aktiv- und Passiv-Matching für Retail- und Wholesalegeschäfte unabhängig voneinander zu beauftragen. Die Angabe einer Bankleitzahl (BLZ) in „ SETTL PARTY - EMPFAENGER: P2" der D-FoP-Instruktion definiert dabei ein Retailgeschäft.

Für Konten, die am Passive Matching Service teilnehmen, ist es auch für die Märkte Frankreich, Niederlande und Belgien möglich, Erhaltinstruktionen/Matchinstruktionen frei von Zahlung einzustellen.

4.5.5 Übersicht zum Match-Dienst (AM)

Ein Match-Auftrag oder eine Match-Instruktion, die/der bereits als „matched" gekennzeichnet ist, kann durch die Eingeber bis zum Zeitpunkt der Disposition über den „Match-Dienst" bearbeitet werden. Der zurückgenommene Match-Auftrag bzw. die zurückgenommene Match-Instruktion wird als gelöscht gekennzeichnet und zur Bestätigung in den Erfassungsstatus generiert. Die verbliebene Match-Instruktion bzw. der verbliebene Match-Auftrag im Auftragsstatus wird dahingehend geprüft, ob eventuell die Matchkriterien eines anderen Gegenauftrages erfüllt werden. In diesem Fall findet ein erneutes Matching statt.

Es können also nur solche Match-Aufträge angezeigt und bearbeitet werden, bei denen der jeweilige Teilnehmer des Matchdienstes als Gutschrift-Konto eingetragen ist. Entsprechend können nur solche Match-Instruktionen angezeigt und bearbeitet werden, bei denen der Teilnehmer des Matchdienstes als Lastschrift-Konto eingetragen ist.

Informationen über selbst erfasste Match-Aufträge / Match-Instruktionen erfolgen nur über den Informationsdienst (KVAI).

```
TRAN: KVAM FC:    SB: ####I##19.11.2014#

AUFTRAGSABWICKLUNG          M A T C H - D I E N S T            AUFTRAGSSTATUS

     SETZEN KENNZEICHEN AUF OFFENE MATCH-AUFTRAEGE ODER MATCH-INSTRUKTIONEN


     MA   MATCH-AUFTRAEGE     : .  M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)
     MI   MATCH-INSTRUKTIONEN : .  M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)

     RM   RUECKNAHME MATCHING :. .........   (AUFTRAGSNUMMER)


          ZUSAETZLICHE        BANK-NR DES KONTRAHENTEN : ....
          AUSWAHL             WKN                      : I ............
                              SETTLEMENT-DAY           : 19.11.2014
                              WRG GEGENWERT            : ...




-- ID-KZ: 7930260003 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 08:05:20 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Mögliche Funktionen:

- „MA“ = Setzen Kennzeichen zu Match-Aufträge
- „MI“ = Setzen Kennzeichen zu Match-Instruktionen
- „RM“ = Rücknahme Matching über Auftragsnummer

Zusätzliche Eingaben:

Neben dem gewünschten Funktionscode können noch zusätzliche Auswahlkriterien zur Eingrenzung der zu bearbeitenden Aufträge eingegeben werden:

Bank-Nr. des Kontrahenten

Mit einer Eingabe im Feld "Bank-Nr. des Kontrahenten" kann eingeschränkt werden, dass nur Match-Aufträge / -Instruktionen einer bestimmten Bank angezeigt werden.

WKN

Mit der Angabe einer WKN kann beeinflusst werden, dass nur Match-Aufträge/-Instruktionen mit einer bestimmten Gattung angezeigt werden.

Settlement-Day

Mit der Angabe eines Settlement-Days kann begrenzt werden, dass nur Match-Aufträge/-Instruktionen mit dem angegebenen Settlement-Day ausgewählt werden. Wenn als Settlement-Day das laufende Datum eingegeben wurde, werden auch alle vorgetragenen Aufträge (mit Settlement-Day älter als heute) berücksichtigt

WRG Gegenwert

Euro ist vorbelegt. Die Eingrenzung kann auf weitere zugelassene Fremdwährungen vorgenommen werden. Durch Auswahl „XXX" im Feld „WRG GEGENWERT" können ausschließlich Settlement Instruktionen ohne Gegenwert angezeigt werden, durch die Auswahl „YYY" ist es möglich, sich ausschließlich Settlement Instruktionen mit Gegenwert in einer der zulässigen Fremdwährungen anzeigen zu lassen. Die Sortierfolge der Anzeige richtet sich hierbei zuerst nach der ISIN und dann nach aufsteigender Nominale.

4.5.6 Bearbeiten offener Match-Aufträge/Match-Instruktionen (MA / MI)

Mit Eingabe des Funktionscodes "MA" und der Angabe "O" für "offen" gelangt man in die Maske "Match-Aufträge / Match-Dienst", mit "MI" und "O" in die Maske "Match-Instruktionen / Match-Dienst".

```
TRAN: KVAM FC: MA SB: M##I###

AUFTRAGSABWICKLUNG             MATCH-AUFTRAEGE / MATCH-DIENST     AUFTRAGSSTATUS

                                                 WRG GEGENWERT : EUR    SEITE   1

KZ  M   S D  AUFTNR  RTS  BANK  WKN           NOMINALE          GEGENWERT   SET-D

_  01   1 1 1234567   N   3456  DE0005000608        1.200         24.000,24 18.01
   01   2 1     934   N   6789  DE0005503451       37.750      2.000.000,00 18.11
_  03   3 1   75933   N   5678  DE0005006781          880          3.200,57 18.11
_  01   2 1   19789   N   3456  DE0005005551          700         42.000,98 18.11
   01   1 1   22233   N   3456  DE0005000651      120.000     35.000.000,00 18.11
_  07   1 1    8877   N   6789  DE0005000701    2.000.000    800.000.000,56 18.11
_  01   3 1  122455   N   5678  DE0005003331      170.000    134.950.000,00 19.11
   01   3 1  137943   N   4567  DE0005000661       95.150     17.322.400,77 19.11
_  01   2 1      51   N   5678  DE0005000651       30.000         90.000,99 19.11
_  01   1 1     256   N   5678  DE0005003571        4.000        160.000,44 19.11
   08   2 1    1342   N   7930  DE0008404001          700          5.600,40 19.11
_  01   3 1   98765   N   4567  DE0005007771        1.500         14.242,00 19.11

-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 08:11:55 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Bei Aufruf des Funktionscodes „MA" mit der Angabe „O" wird eine Maske mit allen offenen Match-Aufträgen, bei denen der Teilnehmer als Gutschrift-Konto eingetragen ist, in tabellarischer Form zur Verfügung gestellt. Daraus sind alle wichtigen Matchkriterien ersichtlich.

In der tabellarischen Anzeige kann mit PF8 vorwärts geblättert werden.

Die einzigen eingabefähigen Felder auf dieser Maske sind das Kennzeichen (KZ) und der Match-Status (M).

Der Match-Status gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages hinsichtlich Matching an. Folgende Match-

Status können bei offenen Match-Aufträgen/Match-Instruktionen auftreten:

Matching offen; kein Gegenauftrag mit übereinstimmenden Matchkriterien gefunden; mögliche Gründe:

- es ist noch kein Gegenauftrag erfasst und an die Clearstream Banking AG übertragen worden;
- der Gegenauftrag ist mit abweichenden Matchkriterien erfasst worden.

Matching offen; es handelt sich um eine alternative Match-Position, d. h. es existieren mehrere gleiche Gegenaufträge, von denen derjenige mit dem ältesten Erfassungsdatum zur Matchbestätigung herangezogen wurde.

- Rücknahme Matching durch den Begünstigten.
- Rücknahme Matching durch den Auftraggeber.

Eingebbare Kennzeichen (KZ)

"F" + Ablehnungsgrund	Ablehnung Match-Auftrag/Match-Instruktion. Auftrag wird nicht zur weiteren Match-Verarbeitung herangezogen
"I"	Vollanzeige

Kennzeichnung mit Ablehnungsgrund (F)

Wenn der Benutzer einen angezeigten Auftrag ablehnt, gibt er ein „F" vor diesem Auftrag ein. Die Eingabe eines „F" bedeutet, dass dieser *Auftrag als fehlerhaft zurückgewiesen* wird.

Bei Kennzeichnung mit „F" muss auch ein *numerischer Fehlercode im Feld Match-Status* eingegeben werden, damit der Kontrahent erkennen kann, aus welchem Grund der Auftrag nicht bestätigt wurde.

Nur bei Fehlercode 10 wird kein Matching durchgeführt. Die weiteren Ausprägungen gelten nur als Information.

Kennzeichnung nur für Information (I)

Wenn dem Benutzer die angezeigten tabellarischen Informationen nicht ausreichen, gibt er im Kennzeichen ein "I" ein, um in die Vollanzeige zu verzweigen.

Das Mischen eines „I" mit anderen Kennzeichen ist nicht erlaubt. Es darf nur ***ein „I"*** eingegeben werden, denn es können nicht gleichzeitig mehrere Aufträge zur Vollanzeige selektiert werden. Bei Eingabe eines „I" darf keine Eingabe im Feld Match-Status erfolgen.

Aus der Vollanzeige gelangt man mit PF3 zurück in die tabellarische Anzeige im Match-Dienst.

4.5.7 Fehlerhafte Match-Aufträge/Match-Instruktionen (MA/MI)

Fehlerhafte Match-Aufträge/Match-Instruktionen erreicht man über den Funktionscode „MA" / „MI" und die zusätzliche Angabe „F" für „fehlerhaft".

4.5.7.1 Keine Matchverarbeitung möglich (es sei denn, der Fehlercode wird gelöscht!)

Bei der Eingabe des folgenden Fehlercodes wird *keine Matchverarbeitung* angestoßen:

Maske	Bedeutung
10	kein Matching zugelassen

4.5.7.2 Matchverarbeitung möglich

Bei der Eingabe des folgenden Fehlercodes wird *die Matchverarbeitung* angestoßen:

Maske	Bedeutung
11	Keine Instruktion durch den Endbegünstigten;
12	Endbegünstigten-Instruktion lautet: "Empfang der Stücke frei";
13	Auftrag betrifft uns nicht
20	Gegenwert außerhalb der Toleranz: zu hoch;
21	Gegenwert außerhalb der Toleranz: zu niedrig;
22	Gegenwert in falscher Währung;
23	Gegenwert bereits separat verrechnet;
24	Abweichen des Settlement-Days;
30	Nominalbetrag/Stückzahl unstimmig;
31	Wertpapier-Nummer unstimmig;
33	Lieferung unvollständig, Telefonabsprache nötig;
35	Ausm. Betrag-Rücknahme außerhalb der Toleranz: zu hoch;
36	Ausm. Betrag-Rücknahme außerhalb der Toleranz: zu niedrig;
37	Abweichen des Rücknahmedatums
40	Endbegünstigter unbekannt bzw. nicht vorhanden;
41	Original-Auftraggeber unbekannt bzw. nicht vorhanden;
50	Kursangabe unstimmig;
51	Schlusstag unstimmig.
60	Abweichender Settlement-Markt
61	Abweichende Depotbank
62	Mögliches Duplikat
63	Abweichendes Settlement System/Period
70	Abweichende Zahlungstyp
71	Abweichende Wertpapier Richtung
72	Abweichende Geld Richtung
73	Abweichender Lieferer CSD
74	Abweichender Empfänger CSD
75	Abweichendes opt out flag
76	Abweichendes cum/ex flag
77	Abweichende Common Trade reference

78	Abweichender Kunde des Lieferers
79	Abweichender Kunde des Empfängers
80	Abweichender Lieferer SAC
81	Abweichender Empfänger SAC
82	Sonstige Abweichung, Absprache mit dem Kontrahenten notwendig

Fehlerhafte Match-Aufträge/Match-Instruktionen können genauso bearbeitet werden wie offene Match-Aufträge / Match-Instruktionen, d. h. folgende Eingaben sind in den Feldern „KZ" und „M" möglich:

4.5.7.2.1 (A) Bearbeiten Match-Aufträge

```
TRAN: KVAM FC: MA SB: M##I###

AUFTRAGSABWICKLUNG            MATCH-AUFTRAEGE / MATCH-DIENST     AUFTRAGSSTATUS

                                                WRG GEGENWERT : EUR    SEITE   1

KZ  M  S D  AUFTNR  RTS  BANK  WKN           NOMINALE          GEGENWERT   SET-D

_  02  1 1 1234567   N   3456  DE0005000608        1.200         24.000,24 18.11
_  02  2 1     934   N   6789  DE0005503451       37.750      2.000.000,00 18.11
   02  3 1   75933   N   5678  DE0005006781          880          3.200,57 18.11
_  02  2 1   19789   N   3456  DE0005005551          700         42.000,98 18.11
   02  1 1   22233   N   3456  DE0005000651      120.000     35.000.000,00 18.11
_  02  1 1    8877   N   6789  DE0005000701    2.000.000    800.000.000,56 18.11
_  02  3 1  122455   N   5678  DE0005003331      170.000    134.950.000,00 19.11
   02  3 1  137943   N   4567  DE0005000661       95.150     17.322.400,77 19.11
_  02  2 1      51   N   5678  DE0005000651       30.000         90.000,99 19.11
_  02  1 1     256   N   5678  DE0005003571        4.000        160.000,44 19.11
   02  2 1    1342   N   7930  DE0008404001          700          5.600,40 19.11
_  01  3 1   98765   N   4567  DE0005007771        1.500         14.242,00 19.11

-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 08:11:55 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"F" = – anderer Ablehnungsgrund als der angezeigte	Ablehnung Match-Auftrag/Match-Instruktion
"F" - 01	Auftrag wieder als „offen" gekennzeichnet
"I"	Vollanzeige zur Information

4.5.8 Rücknahme des Match-Status bei einem bestätigten Auftrag (RM)

In diesem Kapitel geht es um die Löschung eines bereits gematchten Auftrages (Match-Status „02"). Dafür muss die Auftragsnummer des zurückzunehmenden Auftrages bekannt sein.

```
TRAN: KVAM FC:    SB: ####I##19.11.2014#

AUFTRAGSABWICKLUNG           M A T C H - D I E N S T            AUFTRAGSSTATUS

     SETZEN KENNZEICHEN AUF OFFENE MATCH-AUFTRAEGE ODER MATCH-INSTRUKTIONEN


     MA   MATCH-AUFTRAEGE     : .  M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)
     MI   MATCH-INSTRUKTIONEN : .  M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)

     RM   RUECKNAHME MATCHING : .........   (AUFTRAGSNUMMER)


          ZUSAETZLICHE        BANK-NR DES KONTRAHENTEN : ....
          AUSWAHL             WKN                      : I ............
                              SETTLEMENT-DAY           : 19.11.2014
                              WRG GEGENWERT            : ...




-- ID-KZ: 7930260003 -- PW:          ------ B793043G -- 19/11/14 -- 09:18:59 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Ausgehend von der Hauptauswahl gelangt man durch den Funktionscode „AM" in das Menü des Match-Dienstes und von dort durch den Funktionscode „RM" mit der Angabe der gewünschten Auftragsnummer in die Maske „Rücknahme Matching/Match-Dienst". Diese Maske stellt den ausgewählten Auftrag in tabellarischer Form zur Verfügung. Das einzige eingabefähige Feld auf dieser Maske ist das Kennzeichen. Das Feld Match-Status wird gesperrt.

```
TRAN: KVAM FC: RM SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG        RUECKNAHME MATCHING / MATCH-DIENST     AUFTRAGSSTATUS

                                                                      SEITE   1

KZ  M S D  AUFTNR RTS BANK  WKN           NOMINALE           GEGENWERT    SET-D

_  02 0 1 1234567 N  6789  DE0005000681      13.000      2.600.000,26    19.11









-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 08:11:55 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"I"= Verzweigen in den Informationsdienst

"X"= Rücknahme Matching.

Nach PF3 kehrt das System in die Menümaske zurück und gibt eine Verarbeitungsbestätigung aus.

4.5.9 Information zu bestätigten Match-Aufträgen/Match-Instruktionen (MA/MI)

Bestätigte Match-Aufträge / Match-Instruktionen erreicht man über den Funktionscode „MA"/„MI" und die zusätzliche Angabe „M" für „matched".

Bei dieser Anzeige handelt es sich nur um eine Information.

Einzige Eingabemöglichkeit im Feld KZ ist ein „I" zum Verzweigen in die Vollanzeige.

Der Match-Status gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages hinsichtlich Matching an. Bei gematchten Match-Aufträgen/Match-Instruktionen kann nur der Match-Status „02" auftreten:

Auftrag bestätigt mit Gegenauftrag Nummer; Gegenauftrag mit übereinstimmenden Matchkriterien gefunden; (in diesem Fall erhalten Match-Auftrag und Match-Instruktion diesen Status).

```
TRAN: KVAM FC: MA SB: M##I###

AUFTRAGSABWICKLUNG             MATCH-AUFTRAEGE / MATCH-DIENST     AUFTRAGSSTATUS

                                                 WRG GEGENWERT : EUR    SEITE   1

KZ  M   S D  AUFTNR  RTS  BANK  WKN           NOMINALE          GEGENWERT   SET-D

_  02  1 1 1234567   N   3456  DE0005000608        1.200         24.000,24 18.11
   02  2 1     934   N   6789  DE0005503451       37.750      2.000.000,00 18.11
   02  3 1   75933   N   5678  DE0005006781          880          3.200,57 18.11
_  02  2 1   19789   N   3456  DE0005005551          700         42.000,98 18.11
   02  1 1   22233   N   3456  DE0005000651      120.000     35.000.000,00 18.11
   02  1 1    8877   N   6789  DE0005000701    2.000.000    800.000.000,56 18.11
_  02  3 1  122455   N   5678  DE0005003331      170.000    134.950.000,00 19.11
   02  3 1  137943   N   4567  DE0005000661       95.150     17.322.400,77 19.11
_  02  2 1      51   N   5678  DE0005000651       30.000         90.000,99 19.11
_  02  1 1     256   N   5678  DE0005003571        4.000        160.000,44 19.11
   02  2 1    1342   N   7930  DE0008404001          700          5.600,40 19.11
_  01  3 1   98765   N   4567  DE0005007771        1.500         14.242,00 19.11

-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 08:11:55 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

4.5.10 Löschung von Cross-Border Geschäften

Die Löschung von grenzüberschreitenden Transaktionen erfolgt immer im System des Zentralverwahrers des jeweiligen Marktes und wird auf den verschiedenen Märkten unterschiedlich gehandhabt. Dabei entscheiden die Zentralverwahrer (Issuer CSDs) in Abhängigkeit vom Status der Transaktion, ob diese bilateral, unilateral oder nur durch Systemlöschung im betreffenden System gelöscht werden kann.

Die folgende Tabelle zeigt die Märkte, für die CBF die Marktusance für Löschungen von gematchten Instruktionen unterstützt.

Löschungsmodus in Abhängigkeit vom Status der Transaktion im System der einzelnen CSDs

Transaktionsstatus	ESES (Frankreich, Niederlande und Belgien)	Iberclear (Spanien)	OeKB (Österreich)
Kein Matching	unilateral	unilateral	unilateral
Gematcht, aber vom fremden Kontrahenten gesperrt	unilateral (Siehe Fall 1)	unilateral (Siehe Fall 1)	bilateral (Siehe Fall 2)
Gematcht und freigegeben	bilateral (Siehe Fall 2)	Löschung nur vom System möglich	bilateral (Siehe Fall 2)

Fall 1

Nach dem Erhalt einer Löschungsmitteilung aus dem Markt wird die Instruktion des Kontrahenten gelöscht, die Reservierung des Geldes/der Stücke aufrechterhalten.

Die Instruktion des CBF Teilnehmers in CASCADE hat dann Löschstatus 0 und Match-Status 7 („Rücknahme Matching durch Begünstigten") bzw. 8 („Rücknahme Matching durch Auftraggeber").

Der CBF Teilnehmer wird durch den Status NMAT//CPCA über die Löschung des Kontrahenten informiert.

Falls der Kontrahent neu instruiert, wird die ursprüngliche Instruktion setteln.

Ob es sich bei Erhalt des Status NMAT//CPCA um ein noch nicht reserviertes Geschäft handelt oder ob dieses Geschäft noch immer reserviert ist, lässt sich aus dem Depotstatus ersehen.

Fall 2

Der CBF Teilnehmer wird durch den Status IPRC//CPRC über die Löschungsanfrage des Kontrahenten informiert.

Der Auftrag in CASCADE wird erst gelöscht, wenn beide Seiten zugestimmt haben und die Löschungsbestätigung der Lagerstelle vorliegt.

Kunden können sowohl für gematchte FoP-Transaktionen als auch für gematchte DvP- und RvP-Instruktionen bilaterale Löschungen selbst in CASCADE veranlassen. Dies geschieht entweder online, über File Transfer, IBM Websphere MQSeries oder SWIFT. Nachdem die Bestätigung zur Löschung vom jeweiligen Markt vorliegt, wird die Löschung durchgeführt. Werden Löschungen für OTC Transaktionen bestätigt und durchgeführt, für die bereits Stücke- oder Geld reserviert wurde, dann werden diese Reservierungen zurückgenommen.

4.6 Settlement

OTC-Geschäfte

Das System bietet die Möglichkeit, einen *WP-Übertrag (mit/ohne Gegenwert)* bzw. eine *Match-Instruktion* für die entsprechende Disposition zu sperren oder freizugeben. Diese *Settlement-Sperre* wirkt sich aus, unabhängig davon, ob der betreffende Auftrag „matched" ist oder nicht. Andererseits kann aber ein freigegebener, matchpflichtiger Auftrag nur disponiert werden, wenn er „matched" ist.

Die Settlement-Sperre (Feld PARTY-HOLD) kann schon bei der Erfassung bzw. Änderung im Erfassungsstatus gesetzt werden. Durch die *Settlement-Freigabe* kann eine gesetzte Settlement-Sperre wieder aufgehoben und der gesperrte Auftrag damit für die Disposition freigegeben werden.

Settlement-Dienst im Auftragsstatus

Die Settlement-Sperre oder -Freigabe kann im Auftragsstatus über den Settlement-Dienst immer bis zu der nächsten Disposition erfolgen. Es können OTC-Geschäfte bearbeitet werden.

Aufträge mit Continuous Settlement können generell nur vor der Kontrolle gesperrt werden. (In der Disposition abgelehnte Aufträge können bis zur erfolgreichen Disposition gesperrt werden.) Die Aufhebung einer Settlement-Sperre kann während des Dispositionszeitraumes erfolgen (Cont-SDS zwischen 06:00 Uhr und 09:55 Uhr bzw. zwischen 11:00 Uhr und 13:10 Uhr).

Auftraggeber- und Empfänger-Seite können nur den von ihnen selbst eingegebenen WP-Übertrag oder die Match-Instruktion sperren bzw. freigeben.

Eine Sperre durch den Auftraggeber (Eingeber) bewirkt immer die Settlement-Sperre des gesamten Auftrages.

Alle Aufträge, bei denen keine Settlement-Sperre vorliegt, werden automatisch zur nächsten valutagerechten Disposition herangezogen.

Diese beiden genannten Möglichkeiten der Settlement-Sperre/-Freigabe ermöglichen zusammengefasst zwei unterschiedliche Arbeitsweisen der CBF Kunden:

- Sperrung von Aufträgen bei der Erfassung; anschließend über den Settlement-Dienst Freigabe der zu disponierenden Aufträge.
- Erfassung von Aufträgen ohne Sperrung; anschließend über den Settlement-Dienst Sperrung der nicht zu disponierenden Aufträge.

```
TRAN: KVAS FC:    SB: ##18.11.2014#I#####

AUFTRAGSABWICKLUNG        S E T T L E M E N T - D I E N S T      AUFTRAGSSTATUS


      IA   INFO AUFTRAEGE           : .  S/F (GESPERRT/FREIGEGEBEN)
      II   INFO MATCH-INSTRUKTIONEN : .  S/F (GESPERRT/FREIGEGEBEN)

      SA   SETTLEMENT-SPERRE AUFTRAG
      SI   SETTLEMENT-SPERRE MATCH-INSTRUKTION

      FA   SETTLEMENT-FREIGABE AUFTRAG
      FI   SETTLEMENT-FREIGABE MATCH-INSTRUKTION

           ZUSAETZLICHE         SETTLEMENT-DAY   : 18.11.2014
           AUSWAHL              WKN              : I ............
                                LASTSCHRIFT-BANK : ....
                                GUTSCHRIFT-BANK  : ....
                                WRG GEGENWERT    : ...
                                KZ-AA            : .

-- ID-KZ: 7930000099 -- PW:          ------ B79304E4 -- 19/11/14 -- 17:46:54 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

4.6.1 Sperre bzw. Freigabe von Aufträgen für die Disposition (SA, SI, FA , FI)

4.6.1.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Im Rahmen der Funktion Settlement-Sperre/-Freigabe können *Aufträge für alle anstehenden Dispositionen gesperrt bzw. freigegeben* werden. Dabei gilt die Sperre solange, bis der Auftrag entweder wieder freigegeben oder aber aus dem Auftragsstatus gelöscht wird. Demgegenüber gilt ein Auftrag solange als freigegeben, bis er über den Settlement-Dienst wieder gesperrt bzw. durch die nächste Disposition ausgeführt wird.

Hinweis:

Wenn vom Systembenutzer der SETTLEMENT-DAY mit dem Datum des Arbeitstages gefüllt wird, dann können sich unter den angezeigten Aufträgen auch Aufträge mit früherem Settlement-Day befinden, die noch gesperrt bzw. nicht disponiert sind.

Die Kurzanzeige kann über mehrere Seiten gehen. Auf der letzten Seite werden Gesamtsummen über die Anzahl der Aufträge, Nominale und Gegenwert angezeigt.

4.6.1.2 (B) Tabellarische Anzeige

```
TRAN: KVAS FC: SA SB: 18.11.2014#W###7930##

AUFTRAGSABWICKLUNG              SPERRE / SETTLEMENT-DIENST        AUFTRAGSSTATUS

SETTLEMENT-DAY : 18.11.2014  LAST-BANK : 7930   WRG GEGENWERT :       SEITE   1

KZ S   M D  AUFTNR  GUT-KTO   WKN            NOMINALE               GEGENWERT

_  0  02 1 1214365  4567 000  DE0009990001       10.000            2.500.000,00
_  2  12 1 1245678  4567 000  DE0009990002          200               50.000,00
   0  01 1 7314276  5678 000  DE0009990003        7.500            1.875.000,00
_  2  01 1  123455  6789 000  DE0009990004        5.000            1.250.000,00
_  0  22 1  532305  4567 000  DE0009990005       31.500            7.875.000,00
   2  50 1  659032  4567 000  DE0009990009       85.000           21.250.000,00
_  0  02 1  618945  6789 000  DE0009990007          100               25.000,00




GESAMTSUMMEN  ANZAHL AUFTRAEGE:      7           139.300          34.825.000,00

-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 09:12:00 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"I"= Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

"X"= Freigabe einer Match-Instruktion für die nächste Disposition (Set-Status wird auf "0" oder "1" gesetzt)

4.6.1.2.1 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es können *mehrere* Aufträge mit *„X"* gekennzeichnet werden.

Es darf jedoch nur *ein „I"* zum Verzweigen in den Informationsdienst gesetzt werden.

Darüber hinaus darf *„I" nicht mit „X" kombiniert* werden.

Der in der Kopfzeile aufgeführte SETTLEMENT-DAY sowie das LAST-/GUT-KTO gelten für alle Aufträge. Zusätzlich zu den buchungsrelevanten Feldern wird auch der Settlement-Status des jeweiligen Auftrages angezeigt:

Status 0 = Auftrag zur Disposition freigegeben

Status 1 = Auftrag gesperrt durch den Auftraggeber

Status 2 = Auftrag gesperrt durch den Empfänger

Status 3 = Auftrag gesperrt durch Auftraggeber und Empfänger

4.6.1.3 Settlement-Sperre durch den Auftraggeber/Verkäufer (SA)

Unter dem Funktionscode "SA" werden dem Auftraggeber auf der Kurzanzeige alle WP-Überträge angezeigt, die zur Disposition freigegeben sind (Status = 0), und alle WP-Überträge, die vom Empfänger durch Sperren der Match-Instruktion bereits einseitig gesperrt wurden (Status = 2).

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I"= Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

„X"= Sperrung eines WP-Übertrages für die nächste Disposition (Set-Status wird auf „1" oder „3" gesetzt)

4.6.1.4 Settlement-Sperre durch Empfänger/Käufer (SI)

Unter dem Funktionscode "SI" werden dem Empfänger auf der Kurzanzeige alle Match-Instruktionen angezeigt, deren Gegenaufträge zur Disposition freigegeben (Status = 0), und solche, die einseitig von der Gegenseite gesperrt worden sind (Status = 1).

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I"= Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

„X"= Sperrung einer Match-Instruktion für die nächste Disposition (Set-Status wird auf „2" oder „3" gesetzt)

4.6.1.5 Settlement-Freigabe durch Auftraggeber/Verkäufer (FA)

Unter dem Funktionscode "FA" werden dem Auftraggeber auf der Kurzanzeige alle WP-Überträge angezeigt, die er zur nächsten Disposition selbst gesperrt hat (Status = 1), sowie die beidseitig gesperrten Aufträge (Status = 3).

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I"= Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

„X"= Freigabe eines Match-Auftrages für die nächste Disposition (Set-Status wird auf „0" oder „2" gesetzt).

4.6.1.6 Settlement-Freigabe durch Empfänger/Verkäufer (FI)

4.6.1.6.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Unter dem Funktionscode „FI" werden dem Empfänger auf der Kurzanzeige alle Match-Instruktionen angezeigt, die er zur nächsten Disposition selbst gesperrt hat (Status = „2"), sowie die beidseitig gesperrten Aufträge (Status = „3").

Wird vor einem Auftrag das Feld KZ mit „I" überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller erfassten Felder, ggf. über mehrere Masken (für bestimmte Auftragsarten).

4.6.1.6.2 (B) Vollanzeige von Aufträgen

```
TRAN: KVAS FC: SI SB: 19.11.2014#I###7930##

AUFTRAGSABWICKLUNG  MATCH-INSTRUKTION / INFORMATION              AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR   :    443213

LAST     : 7931 000       HANDELSBANK AG                      / BANKDEFFXXX
GUT      : 7930 000       TESTBANK AG                         / TESTDEFFXXX
WKN      : I DE0008032004 COMMERZBANK AG O.N.

NOMINALE :             4.000       EINHEIT: ST        DISPO-PRIORITAET: 4 MST
GEGENWERT:            40.000,00    WRG    : EUR       VWA       : GS  SVG
DCA/REF  :                                            EMISS-EINF: N
SET-DAY  : 18.11.2014              EX-TRD :           BATM/ADEA : N
BOERSENPL:                         OPT-OUT:           RTS-DVP   : N

MATCH-STATUS  :  02 AUFTRAG BESTAETIGT MIT GEGENAUFTRAG NUMMER 000000011
PRTYHLD-STATUS:   0 AUFTRAG ZUR DISPOSITION FREIGEGEBEN
DISPO-STATUS  :   1 STUECKE-DISPOSITION OFFEN



-- ID-KZ: 7930260002 -- PW:          ------ B79303FY -- 19/11/14 -- 10:20:48 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF8:Vor
```

```
TRAN: KVAS FC: SI SB: 19.11.2014#I###7930##

AUFTRAGSABWICKLUNG  MATCH-INSTRUKTION / INFORMATION-2            AUFTRAGSSTATUS


AUFTNR:      443213    WKN: I DE0008032004

T2S ACTOR BIC:                    T2S ACTOR REF    :
                                  MITI REF         :
REFERENZ-NR  :                    AUFTRAGS-REFERENZ:
ALREADY MATCHED      :            PARTIAL SETTL IND:
ISO TRANSACTION CODE :            REASON CODE      :

SCHLUSSTAG   : 14.11.2014         KURS / WRG       :
                                  GEGEN-AUFTNR     :
UEB-GRUND    :



TEXT:


-- ID-KZ: 7930260002 -- PW:          ------ B79303FY -- 19/11/14 -- 10:51:29 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

In den Feldern T2S ACTOR BIC, T2S ACTOR REF, MITI REF, ALREADY MATCHED, PARTIAL SETTL IND, ISO TRANSACTION CODE und REASON CODE werden zurzeit noch keine Daten angezeigt.

```
TRAN: KVAS FC: SI SB: 19.11.2014#I###7930##

AUFTRAGSABWICKLUNG   MATCH-INSTRUKTION / FOLGEINFORMATION        AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR:    443213         WKN: I DE0008032004

SETTL PARTY - LIEFERER
P1:
P2:
P3:
P4:
P5:

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1:
P2:
P3:
P4:
P5:


-- ID-KZ: 7930260002 -- PW:          ------ B79303FY -- 19/11/14 -- 10:51:57 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF7:Zurück
```

Mit Betätigung der Taste PF5 wird die Maske „Status-Information“ angezeigt:

```
TRAN: KVAS FC: SI SB: 19.11.2014#I###7930##

AUFTRAGSABWICKLUNG  MATCH-INSTRUKTION / STATUS-INFORMATION       AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR:      443213    WKN: I DE0008032004

STATUSART           AKT.      BESCHREIBUNG              BEANTR  BEARBEITUNGS
                    STATUS                              STATUS     STATUS
PARTY HOLD-STATUS : 0     FREIGEGEBEN
LOESCH-STATUS     : 0     KEINE LOESCHANFRAGE
DISPO-PRIORITAET  : 4     NORMALE PRIORITAET
PARTIAL SETTL IND :


CSD HOLD-STATUS   : 0     FREIGEGEBEN
CSD VALHOLD-STATUS: 0     FREIGEGEBEN
          RULE-ID :
CoSD HOLD-STATUS  : 0     FREIGEGEBEN
          RULE-ID1:
          RULE-ID2:

-- ID-KZ: 7907260001 -- PW:          ------ B99980J0 -- 19/11/14 -- 14:00:25 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Die Feldbeschreibungen entsprechen denen der Maske „Status Information“ in KVAI/AA, siehe Information zum Auftragsstatus (AI).

Folgende Funktionen stehen zur Verfügung:

Funktionscode	Funktion	Eingaben
IA / II	Informationsanzeige, WP-Überträge/Match-Instruktionen	*Eingabepflichtig*: • "S" für gesperrt • "F" für freigegeben • SETTLEMENT-DAY • LAST-BANK oder GUT-BANK (je nach Funktionscode) muss mit dem Teilnehmerkonto gefüllt sein • WKN (optional) • LAST-BANK und GUT-BANK auch zusammen möglich (optional)
SA	OTC-Geschäfte: vom *Auftraggeber* nicht gesperrte WP-Überträge können gesperrt werden	*Eingabepflichtig*: • SETTLEMENT-DAY • LAST-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • GUT-BANK (optional) *Eingabepflichtig*: • SETTLEMENT-DAY • LAST-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • GUT-BANK (optional)
SI	OTC-Geschäfte vom *Empfänger* nicht gesperrte Match-Instruktionen können gesperrt werden	*Eingabepflichtig*: • SETTLEMENT-DAY • GUT-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • LAST-BANK (optional) *Eingabepflichtig*: • SETTLEMENT-DAY • GUT-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • LAST-BANK (optional)
FA	OTC-Geschäfte vom *Auftraggeber* gesperrte WP-Überträge können freigegeben werden	*Eingabepflichtig*: • SETTLEMENT-DAY • LAST-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • GUT-BANK (optional) *Eingabepflichtig*: • SETTLEMENT-DAY • LAST-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • GUT-BANK (optional)
FI	OTC-Geschäfte vom *Empfänger* gesperrte	*Eingabepflichtig*

	Match-Instruktionen können freigegeben werden	• SETTLEMENT-DAY • GUT-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • LAST-BANK (optional) *Eingabepflichtig*: • SETTLEMENT-DAY • GUT-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • LAST-BANK (optional)

Im Settlement-Dienst hat der User somit die Möglichkeit:

- sich über gesperrte/freigegebene WP-Überträge bzw. Match-Instruktionen zu informieren,
- WP-Überträge bzw. Match-Instruktionen für die Disposition zu sperren sowie
- WP-Überträge bzw. Match-Instruktionen für die Disposition freizugeben.

4.6.2 Informationen

4.6.2.1 Gesperrte und freigegebene Aufträge (IA / II)

Nachfolgend sollen die Informationsmöglichkeiten über gesperrte / freigegebene Aufträge im Rahmen des SETTLEMENT-DIENSTES vorgestellt werden.

4.6.2.1.1 (A) Allgemeines

Alle den Auswahlkriterien entsprechenden Aufträge (WP-Überträge oder Match-Instruktionen) werden in Kurzform angezeigt.

Hinweis:

Wenn vom Systembenutzer der SETTLEMENT-DAY mit dem Datum des Arbeitstages gefüllt wird, dann können sich unter den angezeigten Aufträgen auch Aufträge mit früherem Settlement-Day befinden, die noch gesperrt bzw. nicht disponiert sind.

Die Kurzanzeige kann über mehrere Seiten gehen. Auf der letzten Seite werden Gesamtsummen über die Anzahl der Aufträge, Nominale und Gegenwert angezeigt.

4.6.2.1.2 (B) Tabellarische Anzeige aller Geschäfte

```
TRAN: KVAS FC: II SB: #19.11.2014#W###7930##

AUFTRAGSABWICKLUNG        INFORMATION / SETTLEMENT-DIENST        AUFTRAGSSTATUS

SETTLEMENT-DAY : 18.11.2014  GUT-BANK  : 7930   WRG GEGENWERT :       SEITE   1

KZ S  M D  AUFTNR  LAST-KTO  WKN              NOMINALE              GEGENWERT

_  2 10   1456789  6789 000  DE0004895131    2.500.350,525        2.334.180,55
_  2 21   2234543  6789 000  DE0009996002      100.000            1.307.125,85
   3 30    214365  6789 000  DE0009992003          200              105.000,00
_  2 31    123455  6789 000  DE0009991004       10.000            2.500.000,50
_  3 33    854721  6789 000  DE0004999996      125.460,175          117.932,41
   3 10    590760  6789 000  DE0004903207       44.800,500           43.904,49
_  3 51    136238  6789 000  DE0009990005    1.000.000           22.500.000,00
   2 10    298705  6789 000  DE0009993001          550              482.931,50



GESAMTSUMMEN  ANZAHL AUFTRAEGE:      8          3.781.361,200     29.391.075,30

-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 09:00:00 --

PF3:VERARBEITUNG  PF4:ABBRUCH
```

Eingebbares Kennzeichen (KZ):

"I"= Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

4.6.2.1.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es ist nur *ein KZ „I"* auf einer Maskenseite erlaubt, d. h. es können nicht gleichzeitig mehrere Aufträge zur Vollanzeige selektiert werden.

Der in der Kopfzeile aufgeführte SETTLEMENT-DAY sowie das LAST-/GUT-KTO gelten für alle Aufträge. Zusätzlich zu den buchungsrelevanten Feldern wird auch der Settlement-Status des jeweiligen Auftrages angezeigt:

Status 0 = Auftrag zur Disposition freigegeben

Status 1 = Auftrag gesperrt durch den Auftraggeber

Status 2 = Auftrag gesperrt durch den Empfänger

Status 3 = Auftrag gesperrt durch Auftraggeber und Empfänger

Durch die Settlement-Sperre bzw. Freigabe (vgl. unten) wird der Status verändert.

Wird vor einem Auftrag das Feld KZ mit „I" überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller erfassten Felder, ggf. über mehrere Masken (für bestimmte Auftragsarten).

4.6.2.1.4 (D) Vollanzeige eines Auftrages im Settlementdienst

```
TRAN: KVAS FC: II SB: F#19.11.2014#I###7931##

AUFTRAGSABWICKLUNG  MATCH-INSTRUKTION / INFORMATION              AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR   :   8219467

LAST     : 7201 000       CLEARSTREAM BANKING S.A.,LUXEMBOURG /
GUT      : 7931 000       HANDELSBANK AG                      / BANKDEFFXXX
WKN      : I DE0001135424 2,5 % BUNDANL.V. 10/21 04.01.G

NOMINALE :         5.000.000       EINHEIT: EO        DISPO-PRIORITAET: 4 MST
GEGENWERT:         4.982.061,64    WRG    : EUR       VWA       : GS  STV
DCA/REF  :                                            EMISS-EINF: N
SET-DAY  : 19.11.2014              EX-TRD :            BATM/ADEA : N
BOERSENPL: GMTS                    OPT-OUT:            RTS-DVP   : N

MATCH-STATUS   : 01 MATCHING OFFEN; KEINEN GEGENAUFTRAG GEFUNDEN
PRTYHLD-STATUS :  0 AUFTRAG ZUR DISPOSITION FREIGEGEBEN
DISPO-STATUS   :  1 STUECKE-DISPOSITION OFFEN
SB-STATUS      : 10 AUFTRAG IST NICHT FUER SELBSTBESICHERUNG MARKIERT

-- ID-KZ: 7931260001 -- PW:          ------ B79313FX -- 19/11/14 -- 12:26:52 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF8:Vor
```

```
TRAN: KVAS FC: II SB: F#19.11.2014#I###7931##

AUFTRAGSABWICKLUNG  MATCH-INSTRUKTION / INFORMATION-2            AUFTRAGSSTATUS


AUFTNR:   8219467      WKN: I DE0001135424

T2S ACTOR BIC:                     T2S ACTOR REF    :
                                   MITI REF         :
REFERENZ-NR  :                     AUFTRAGS-REFERENZ:
ALREADY MATCHED      :             PARTIAL SETTL IND:
ISO TRANSACTION CODE :             REASON CODE      :

SCHLUSSTAG   : 14.11.2014          KURS / WRG       :
                                   GEGEN-AUFTNR     :
UEB-GRUND    :



TEXT:


-- ID-KZ: 7931260001 -- PW:          ------ B79313FX -- 19/11/14 -- 12:31:45 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

```
TRAN: KVAS FC: II SB: F#19.11.2014#I###7931##

AUFTRAGSABWICKLUNG  MATCH-INSTRUKTION / SETL.PTY-INFORMATION     AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR:   8219467      WKN: I DE0001135424

SETTL PARTY - LIEFERER
P1:
P2: KTO 70496
P3: KTO 70496
P4:
P5:

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1:
P2:
P3:
P4:
P5:


-- ID-KZ: 7931260001 -- PW:          ------ B79313FX -- 19/11/14 -- 12:32:36 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF7:Zurück
```

Mit Betätigung der Taste PF5 wird die Maske „Status-Information“ angezeigt:

```
TRAN: KVAS FC: II SB: 19.11.2014#I###7930##

AUFTRAGSABWICKLUNG  MATCH-INSTRUKTION / STATUS-INFORMATION       AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR:      443213    WKN: I DE0008032004

STATUSART           AKT.      BESCHREIBUNG              BEANTR  BEARBEITUNGS
                    STATUS                              STATUS     STATUS
PARTY HOLD-STATUS : 0     FREIGEGEBEN
LOESCH-STATUS     : 0     KEINE LOESCHANFRAGE
DISPO-PRIORITAET  : 4     NORMALE PRIORITAET
PARTIAL SETTL IND :


CSD HOLD-STATUS   : 0     FREIGEGEBEN
CSD VALHOLD-STATUS: 0     FREIGEGEBEN
          RULE-ID :
CoSD HOLD-STATUS  : 0     FREIGEGEBEN
          RULE-ID1:
          RULE-ID2:

-- ID-KZ: 7907260001 -- PW:          ------ B99980J0 -- 19/11/14 -- 14:00:25 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Die Feldbeschreibungen entsprechen denen der Maske „Status Information“ in KVAI/AA, siehe Information zum Auftragsstatus (AI).

4.7 Reservierungs-Dienst im Real-Time-Settlement (AR)

4.7.1.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Im Rahmen des Real-Time-Settlement (RTS) – als Verfahren zur sofortigen Abwicklung von Wertpapierüberträgen mit Gegenwert EUR über das CASCADE-System – werden nach dem Matching des WP-Übertrags mit der Match-Instruktion des Käufers die zu übertragenden Wertpapiere auf der "Lieferseite" (Verkäufer) auf dem Unterkonto XXXX/995 separiert. Die Reservierung für Wertpapierüberträge mit Gegenwert Fremdwährung wird ebenfalls auf dem Unterkonto XXXX/995 RTS vorgenommen (für weitere Informationen hierzu siehe das CBF Customer Handbook).

Die Ergebnisse der Reservierungsverarbeitung kann der *Verkäufer* in CASCADE über zwei Wege abrufen:

- Information im Auftragsstatus (Transaktion: KVAI Funktion: „SR“)
- Reservierungs-Dienst (Transaktion: KVAR)

Wird in der Hauptauswahlmaske der Reservierungsdienst über den Funktionscode "AR" angegeben, so wird in folgende Maske verzweigt:

4.7.1.1.2 (B) Auswahlmaske Reservierungsdienst

```
TRAN: KVAR FC:    SB: ####

AUFTRAGSABWICKLUNG     R E S E R V I E R U N G S - D I E N S T   AUFTRAGSSTATUS


     IR   ANZEIGEN RESERVIERUNGEN MIT GEGENWERT EUR

     IW   ANZEIGEN RESERVIERUNGEN MIT GEGENWERT FREMDWAEHRUNG


     RR   RUECKNAHME RESERVIERUNG : ......... (AUFTRAGSNUMMER)


          ZUSAETZLICHE          BANK-NR         : ....
          AUSWAHL               WKN             : . ............
                                WRG GEGENWERT   : ...




-- ID-KZ: 7930260002 -- PW:          ------ B793058S -- 19/11/14 -- 11:02:57 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Folgende Funktionen stehen zur Verfügung:

Funktionscode	Funktion	Eingaben
IR	Informationsanzeige reservierte WP-Überträge mit Gegenwert EUR	*Eingabepflichtig*: • - *Optional*: • BANK-NR DES KONTRAHENTEN • WKN • WAEHRUNG
IW	Informationsanzeige reservieren WP-Überträge mit Gegenwert Fremdwährung	*Eingabepflichtig*: • - *Optional*: • BANK-NR DES KONTRAHENTEN • WKN • WAEHRUNG
RR	Rücknahme der reservierten WP-Überträge mit Fremdwährung	*Eingabepflichtig*: • AUFTRAGSNUMMER *Optional:* • -

4.7.2 Anzeige Reservierungen mit Gegenwert EUR (IR)

4.7.2.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Hat der Anwender die Anzeige der reservierten Aufträge mit Gegenwert EUR (IR) ausgewählt, so erscheint folgende Maske:

4.7.2.1.2 (B) Tabellarische Anzeige/Reservierungsdienst

```
TRAN: KVAR FC: IR SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG   R E S E R V I E R U N G S - D I E N S T    AUFTRAGSSTATUS

                     INFORMATION RESERVIERUNGEN MIT GEGENWERT EUR    SEITE   1

KZ  M  S D  AUFTNR BANK WKN             NOMINALE           GEGENWERT WRG SET-D

_  02  0 6 1124003 7501 DE0001030001         100           50.000,00 EUR 19.11
_  02  0 6     233 6789 DE0005500001      12.100          150.000,00 EUR 19.11
   02  0 6    8901 5678 DE0005500902   1.744.100,999      150.000,00 EUR 19.11









-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 10:37:15 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"I" = Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

"D" = Druck aller Daten des selektierten Auftrages

4.7.2.1.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Der Benutzer kann nur einen Auftrag für die Vollanzeige auswählen, d. h. er darf in der Spalte KZ nur *ein „I"* eingeben. Außerdem darf „I" nicht mit der Eingabe eines „D" kombiniert werden.

Die Markierung mehrerer Aufträge mit dem Kennzeichen "D" *ist zulässig.*

4.7.3 Anzeige Reservierungen mit Gegenwert Fremdwährung (IW)

4.7.3.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Hat der Anwender die Anzeige der reservierten Aufträge mit Gegenwert Fremdwährung (IW) ausgewählt, so erscheint folgende Maske:

4.7.3.1.2 (B) Tabellarische Anzeige reservierter Aufträge

```
TRAN: KVAR FC: IR SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG   R E S E R V I E R U N G S - D I E N S T    AUFTRAGSSTATUS

            INFORMATION RESERVIERUNGEN MIT GEGENWERT FREMDWAEHRUNG   SEITE   1

KZ  M S D  AUFTNR BANK WKN           NOMINALE              GEGENWERT WRG SET-D

_  02 0 6 7124003 8501 DE0001030001              100       50.000,00 USD 19.11
_  02 0 6     233 6789 DE0005500009           12.100      150.000,00 USD 19.11
   02 0 6    8901 5678 DE0005500900        1.744.100,999  150.000,00 USD 19.11









-- ID-KZ: 7930000004 -- PW:          ------ B7930007 -- 19/11/14 -- 10:37:15 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Eingebbares Kennzeichen (KZ):

"I" = Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

Nach PF3 wird der vollständige Auftrag angezeigt.

4.7.4 Rücknahme der Reservierung (RR)

4.7.4.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Die Rücknahme einer erfolgreichen Reservierung für Geschäfte mit Gegenwert Fremdwährung kann der *Verkäufer* über die Funktion „RR Rücknahme Reservierung" vornehmen. Die Rücknahme bewirkt die Erzeugung eines Widerrufs. Die Freigabe der reservierten Stücke erfolgt nur, wenn der Widerruf der entsprechenden Geldüberweisung bei CBL erfolgreich war, d. h. wenn die Überweisung noch nicht getätigt wurde. Zusätzlich wird durch die Rücknahme der Übertragungsauftrag des Verkäufers aus dem Auftragsbestand gelöscht und in den Erfassungsbestand generiert. Die Match-Instruktion des Käufers bleibt im Auftragsstatus mit geändertem Match-Status ("01 Matching offen") und verändertem Dispositionsstatus.

4.7.4.2 Rücknahme Reservierung mit Gegenwert Fremdwährung

Die Rücknahme kann mit der Eingabe des entsprechenden Kennzeichens veranlasst werden.

4.7.4.2.1 (C) Auswahl Reservierungs-Dienst mit Gegenwert Fremdwährung

```
TRAN: KVAR FC: RR SB: 024001#7930

AUFTRAGSABWICKLUNG   R E S E R V I E R U N G S - D I E N S T     AUFTRAGSSTATUS

                           RUECKNAHME RESERVIERUNG                    SEITE   1

KZ  M S D  AUFTNR BANK WKN            NOMINALE             GEGENWERT WRG SET-D
_  02   6 1224001 7531 DE0001030001        890            350.000,00 USD 19.11









-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B7930703 -- 19/11/14 -- 11:38:20 --

PF2:Druck  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

"X" = Rücknahme der Reservierung

"I" = Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

"D"= Druck aller Daten des selektierten Auftrages

Hinweis:

Nach der Eingabe des Kennzeichens „X" muss die Rücknahme mit PF3 bestätigt werden.

Rücknahme von Reservierungen von CCP SIS Crossborder Surplus Deliveries und/oder OTC-Crossborder-Geschäften (SIS) ist *nicht* möglich.

5 Abwicklung von CCP-Instruktionen

Mit Einführung des zentralen Kontrahenten (CCP) sind mit den weiteren Stufen alle an der Frankfurter Wertpapier Börse (FWB) und/oder Xetra getätigten Geschäfte in deutschen (DE-ISIN) und ausländischen und EURO-denominierten GS-verwahrten Aktien sowie GS-verwahrten XTF, Eurex-Bonds, Eurex-Repo sowie physische Lieferungen aus dem Eurex Derivatives Markt in die CCP-Abwicklung einbezogen.

Mit der Einführung des CCP für den deutschen Markt hat Clearstream Banking AG, Frankfurt (CBF) die Abwicklung der nicht aufrechenbaren CCP-Geschäfte d. h. Lieferspitzen sowie die im CCP-System als Brutto-Geschäfte gekennzeichneten Börsengeschäfte (surplus delivery = delivery versus payment oder free of payment) für CBF Teilnehmer übernommen. Wobei in der CASCADE-OTC-Auftragsabwicklung keine Unterscheidung dieser zwei CCP-Geschäftsarten vorgenommen wird.

Zugelassene Gattungen

Alle für die verschiedenen Produkte zu liefernden Wertpapiere sind zur GS-Verwahrung zugelassen. Dies bedeutet, dass Lieferungen nur über GS-Bestände abgewickelt werden können.

Verrechnung der Gegenwerte aus Kapitaldienste

Die Verrechnung der Gegenwerte aus Kapitaldiensten auf offene Brutto Geschäfte erfolgt gemäß der durch den Teilnehmer gewählten Kontoverbindung bei der Eurex Clearing AG.

5.1 Auftragserteilung

Die Instruktionen (surplus delivery instructions) werden automatisch aus dem CCP-System an S-1 (Settlement-Day -1) vor Beginn der abendlichen STD-Verarbeitung an CASCADE übergeleitet. Am Settlement-Day können weitere Instruktionen bzw. Änderungen durch den CCP zu den jeweiligen Dispositionszyklen bzw. in den möglichen Dispositionsarten folgen.

5.2 Auftragsbearbeitung und Settlement in EUR

Der Equity CCP erteilt zentral die Aufträge an CASCADE als OTC-Match-Aufträge bzw. OTC-Match-Instruktionen gegen Zahlung von EUR für Aktien für sein eigenes Konto (8501) und für die Konten der CBF-Teilnehmer („on behalf"). Für Eurex-Bonds / Eurex-Repo werden OTC-Match-Aufträge bzw. OTC Match-Instruktionen gegen Zahlung von EUR für sein eigenes Konto (7525) und für die Konten der CBF-Teilnehmer erteilt („on behalf").

5.2.1 Besonderheiten für CBF Equity CCP Konto (8501)

CCP-Instruktionen fließen in den CASCADE OTC-Auftragsbestand ein. Für die "on behalf" eingestellten Aufträge wird ein exklusiver Auftragsnummernkreis (größer 7000000) genutzt.

Unter dem Transaktionscode KVAI-AA sind die CCP-Instruktionen über die Unterauftragsart "A" (Auftragsart 01 bzw. 02) selektierbar. Die Buchungstextschlüssel entsprechen denen für OTC-Geschäfte (06).

Die Aufträge werden mit der höchsten Dispositionspriorität "1 = SHO - sehr hoch" vom CCP eingestellt. Alle Aufträge werden gegen das Konto des CCP 8501 eingestellt und reguliert.

CCP-Aufträge werden ausschließlich in den Batchverarbeitungen (STD/Batch, SDS1/Batch und SDS2/Batch) reguliert.

Kann ein CCP-Auftrag in CASCADE am Settlement-Day nicht reguliert werden, wird der Auftrag nach Ende der 2. SDS-Verarbeitung vom CCP gelöscht.

Die CCP-Aufträge werden in den CASCADE-Tageslisten, Regulierungslisten in der Spalte Bemerkungen mit "CI" und Auftragsnummer, Clearing and Settlement Statement mit einer Zusatzinformation im Feld 94B "ECAG", übernommen.

5.2.2 Regulierung von Geschäften in Wertpapieren gegen Zahlung in EUR

Die Regulierung von Geschäften in Wertpapieren gegen EUR ist in allen Settlementarten möglich (Ausnahme: RTS mit EUR-Gegenwert nur für Eurex-Bonds /Eurex-Repo surplus deliveries).

5.2.3 Regulierung von Geschäften in Wertpapieren gegen Zahlung in Fremdwährung

Die Regulierung von Geschäften in Wertpapieren gegen Fremdwährung ist nur in der Settlementart RTS möglich.

5.3 Auftragsbearbeitung und Settlement in CHF

Deutsche Eurex-Clearer können über CBF, schweizer Eurex-Clearer über die SIX SIS AG physische Leistungen zur Erfüllung von CCP surplus deliveries in deutschen und schweizer Basistiteln abwickeln.

Dazu wird die zwischen den beiden beteiligten Zentralverwahrern (CSD-link) bestehende Verbindung genutzt, die eine grenzüberschreitende und garantierte Lieferung-gegen-Zahlung in EURO bzw. CHF sicherstellt.

Für die Geldabwicklung müssen die Clearing-Mitglieder entweder pro Währung ein Konto nach Maßgabe der Eurex einrichten oder über Korrespondenzbankverbindungen die Geldseite mit Einzugsermächtigungen für 'Cash Calls' sicherstellen. Bei der Alternative einer Konteneinrichtung ist für EUR-Gegenwerte das TARGET2-System und für CHF-Gegenwerte die Schweizer Nationalbank (SNB) zuständig.

Die Währung der Geldabwicklung hängt immer von dem Heimatland der jeweiligen Wertpapiergattung ab (EUR für deutsche und ausländische Wertpapiere, CHF für schweizer Wertpapiere).

Für aus dem Derivatives Markt zu beliefernde schweizer Wertpapiere gegen Zahlung von CHF erteilt der CCP die Aufträge für CBF Teilnehmer über sein eigenes SIS Konto als OTC-Match-Auftrag bzw. OTC-Matchinstruktion gegen Zahlung von CHF als Cross-Border-Auftrag (SIS Omnibus Konto 7215 unter der Angabe des Endbegünstigten Kontos bzw. Originalauftraggeberkontos des CCP).

5.3.1 Regulierung von Geschäften in schweizer Wertpapieren gegen Zahlung in CHF via Schweizerische Zentralbank

Die Regulierung von CCP Surplus Deliveries in schweizer Gattungen erfolgt in der Standard-Batchverarbeitung sowie im RTS-Continuous Settlement. Mitbesitz im GS-Wertpapierbestand in schweizer Gattungen ist hierfür erforderlich.

Wertpapiere, die gegen Zahlung von CHF durch einen CBF Kunden geliefert werden, müssen im Depotbuchbestand verbucht sein, d. h. der Verkäufer muss rechtlicher Besitzer der Wertpapiere sein. Es erfolgt zunächst eine Reservierung der Stücke auf dem Unterkonto /955. Reservierungen werden nur bis 12:30 Uhr durchgeführt. Es kann keine Reservierungsrücknahme vom Lieferer vorgenommen werden. Bei Aufträgen, die mangels Deckung-Geld nicht gebucht werden können, erfolgt eine automatische Reservierungsrücknahme.

Der Erhalt von schweizer Wertpapieren gegen Zahlung CHF erfolgt immer mit sofortigem Mitbesitzübergang. Auf Zahlungsbestätigungen durch die Schweizer Nationalbank, die durch die SIS weitergegeben werden, erfolgt immer eine finale Stücke- und Geldbuchung bei der CBF.

5.4 Reporting regulierter CCP-Instruktionen

Alle in EURO regulierten CCP Surplus Deliveries werden in der EUR-Regulierungsliste aufgeführt.

Alle in CHF gebuchten CCP Surplus Deliveries werden in der FW-Regulierungsliste nach jedem Settlementzyklus aufgelistet.

5.4.1 Regulierungsliste Euro

Alle in Euro regulierten CCP Surplus Deliveries werden in der bestehenden Euro Regulierungsliste nach jedem Settlementzyklus aufgeführt.

Alle CCP Surplus Deliveries werden als Wertpapierübertrag verbucht und entsprechend mit dem Buchungsschlüssel „06“ausgewiesen.

Alle CCP Teilnehmer als Kunden der SIS haben SIS als Korrespondenzbank für die Euro Verrechnung gewählt.

5.4.2 Regulierungsliste für Fremdwährung (FW)

Alle in FW regulierten CCP Surplus Deliveries sind in der Regulierungsliste für Fremdwährung enthalten unter Angabe der Verrechnungsstelle.

Für Ausübungen in schweizer Gattungen gegen Zahlung von CHF sind die gebuchten CCP Surplus Deliveries weiterhin in der FW-Regulierungsliste nach jedem Settlementzyklus enthalten und die entsprechende Verrechnung der CHF bei der Schweizer Nationalbank entsprechend ausgewiesen. Als Gegenkonto wird das CBF SIS Gegenkonto 7215 angezeigt.

5.4.3 Buchungstextschlüssel

Die Reservierungen und Buchungen von CCP Surplus Deliveries in CASCADE werden wie folgt ausgewiesen:

- CBF Konto 8501 - CCP Aktien mit Euro Settlement
  - Buchungsschlüssel „06“ für Buchungen von CCP Surplus Deliveries mit Euro Gegenwert
- CBF Konto 7525 - CCP Renten mit Euro Settlement
  - Buchungsschlüssel „50“ für Buchungen von CCP Surplus Deliveries mit Euro Gegenwert
- CBF SIS Omnibus Konto 7215 - CCP Renten und Aktien mit CHF Settlement
  - Buchungsschlüssel „08“ für Reservierungen für CCP Surplus Deliveries mit CHF Gegenwert
  - Buchungsschlüssel „97“ für Reservierungsrücknahmen ohne finale Buchung
  - Buchungsschlüssel „06“ für finale Buchungen von CCP Surplus Deliveries mit CHF Gegenwert.

5.4.4 Regulierungsdatenträger MT536

Alle CCP Surplus Deliveries werden einheitlich im Feld (94B)„Handelsort“ / „Trade place“ mit der Ausprägung mit „ECAG“ (für Eurex Clearing AG) ausgewiesen.

Zusätzlich wird das Feld (98A/C „Schlusstag“/„Trade Date“ mit demselben Datum aus dem Feld „Vereinbarter Settlement Tag“ gefüllt.

Teilnehmer, die für einen schweizer Clearer als Korrespondenzbank die EUR-Verrechnung vornehmen, erhalten eine Auflistung über die aufgrund der Korrespondenzbankverbindungen anfallenden Zahlungen.

Details zum MT536 sind im CBF Connectivity Handbook beschrieben.

5.4.5 SWIFT-Settlement Confirmations (MT544-MT547) und Weiterleitungen (MT578)

Alle CCP Surplus Deliveries werden einheitlich im Feld (94B)„Handelsort“/“Trade Place“ mit der Ausprägung „ECAG“ ausgewiesen.

Zusätzlich wird das Feld (98A) „Schlusstag“/„Trade Date“ mit demselben Datum aus dem Feld „Vereinbarter Settlement Tag“ gefüllt.

Details zu den MT544-MT547 und dem MT578 sind im CBF Connectivity Handbook beschrieben.

6 Geldregulierung in Euro

Die Geldregulierung in Euro erfolgt für alle CASCADE-Geschäftsbereiche über RTGS-Konten der Kunden im TARGET2-Sytem, dem zentralen Eurozahlungssystem des Eurosystems (EZB und alle nationalen Zentralbanken des Euroraums).

Für die Geldabwicklung werden drei unterschiedliche vom Eurosystem definierte und standardisierte Prozesse, die so genannten TARGET2-Prozeduren, genutzt.

- Prozedur 6: Die Geldregulierung für die innerhalb der Tag- und Nachtverarbeitung abgewickelten Wertpapiergeschäfte und die Kapitaldienstzahlungen des Bundes erfolgt über vorab reservierte Liquidität auf einem TARGET2-Unterkonto (RTGS sub-account for dedicated liquidity). CBF spiegelt die auf der TARGET2-Seite reservierte Liquidität auf einem CBF-internen Geldverrechnungskonto (XXXX/220) des Kunden wider und verbucht dort die entsprechenden Geldumsätze. Nach jedem Verarbeitungslauf wird ein Nettobetrag ermittelt, der über das TARGET2-Unterkonto des Kunden eingezogen bzw. ausgezahlt wird.
- Prozedur 3: Die Geldregulierung für sonstige Kapitaldienstzahlungen (außer Bund) und sonstige Zahlungen (Gebühren, Kursdifferenzen etc.) werden von CBF in den Direct Debit Geldverrechnungsprozessen DD1, DD2 und DD3 abgerechnet und nachträglich in bis zu jeweils neun Beträgen (Paketen) direkt über die TARGET2-Hauptkonten eingezogen bzw. ausgezahlt.
- Prozedur 2: Die Geldregulierung von Wertpapiergeschäften, die innerhalb der RTS-Verarbeitung abgewickelt werden, erfolgt auf Bruttobasis (einzeln pro Geschäft) direkt über die TARGET2-Konten beider Kontrahenten.

Im Folgenden werden die CASCADE-Funktionen beschrieben, die diese Prozesse unterstützen.

6.1 Nachtverarbeitung (STD, RT-STD) Tagesverarbeitung (Cont-SDS1, SDS1, Cont-SDS2, SDS2)

Für folgende Abwicklungszyklen muss Liquidität vorab reserviert werden:

Nachtverarbeitung	
STD (Standard – Verarbeitung)	19:00 Uhr bis ca. 21:00 Uhr
RT-STD (Realtime Standard)	01:30 Uhr bis 06:00 Uhr
Tagesverarbeitung	
C1F1 (Cont–SDS1)	07:10 Uhr bis 08:00 Uhr
C1F2 (Cont–SDS1)	08:00 Uhr bis 09:00 Uhr
C1F3 (Cont–SDS1)	09:00 Uhr bis 10:00 Uhr
SDS 1	10:00 Uhr bis ca. 10:40 Uhr
C2F1 (Cont–SDS2)	11:00 Uhr bis 12:00 Uhr
C2F2 (Cont–SDS2)	12:00 Uhr bis 13:15 Uhr
SDS2	13:15 Uhr bis ca. 13:45 Uhr

Durch Eingabe des Funktionscodes „CG" im CASCADE-Einstiegsmenü „Funktionsangebot für den Bereich Clearstream Banking AG, Frankfurt-Domestic" wird das Hauptauswahlmenü Auftragsabwicklung Geld aufgerufen:

```
TRAN: MENU FC:    SB:

 AUFTRAGSABWICKLUNG GELD     H A U P T A U S W A H L

    LIQUIDITÄTSMANAGEMENT


        GI INFORMATION SETTLEMENT           ZI INFORMATION KAPITALDIENSTE
                                               UND SONSTIGE GELDUMSÄTZE

        EE ERFASSUNG

        EA ÄNDERUNG/LÖSCHUNG


        CC CBF INTERN




 -- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B793058R -- 27/01/10 -- 16:43:35 --
KN1001I Funktion beendet, bitte nächste Funktion wählen
```

6.1.1 Auftragserteilung (EE)

Unter der Erfassung ist die *Neueingabe von Geldaufträgen* zu verstehen.

Kunden der CBF können die folgenden Funktionscodes nutzen um verschiedene die Geldreservierung betreffende Aufträge zu erteilen:

Einzelaufträge

RA = Reservierung

Daueraufträge:

DR = Reservierung

DW = Geldkontenverknüpfung zur Weiterleitung der Reservierung

DP = Priorisierung der Geldquellenverwendung

DM = Dauerauftrag für Marktregel bei Liquiditätsunterdeckung

Ausgehend von dem Auswahlmenü der Auftragsabwicklung Geld gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes "EE" zum Auswahlmenü der Erfassung für Geldaufträge:

```
TRAN: KNEE FC:    SB:

 GELDAUFTRÄGE       E R F A S S U N G

       EINZELAUFTRÄGE
       RA  RESERVIERUNG


       DAUERAUFTRÄGE
       DR  RESERVIERUNG

       DW  GELDKONTENVERKNÜPFUNG ZUR WEITERLEITUNG DER RESERVIERUNG
       DP  PRIORISIERUNG DER GELDQUELLENVERWENDUNG
       DM  DAUERAUFTRAG FÜR MARKTREGEL BEI LIQUIDITÄTSUNTERDECKUNG









 -- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79303FX -- 05/08/11 -- 11:35:09 --
 KN1502F Feld muss einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
 PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

6.1.1.1 Erfassung von Reservierungsaufträgen (RA)

6.1.1.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

In dieser Funktion können Einzelreservierungsaufträge für Geldverrechnungskonten und Fundingkonten erfasst werden. Diese werden jedoch nur einmal für den folgenden, im Auftrag definierten, Zyklus ausgeführt. Hat ein Kunde bereits einen Dauerauftrag für diesen Zyklus erteilt, kann er ihn durch Eingabe eines individuellen Reservierungsauftrags einmalig überschreiben, d. h. der Dauerauftrag wird einmalig ignoriert und stattdessen wird der Einzelauftrag ausgeführt.

Hinweis: Nach Eingabe des Funktionscodes „RA" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

6.1.1.1.2 (B) Eingabemaske Reservierungsauftrag

```
TRAN: KNEE FC: RA SB:

RESERVIERUNGSAUFTRAG / E R F A S S U N G

GELDKONTO: 7930 220 TESTBANK AG

TAG DER GELDVERRECHNUNG: 04.02.2009 VERARBEITUNGSLAUF: STD
RESERVIERUNGSFRIST:      03.02.2009 19:00 UHR



ANFORDERUNG:             3.000.000.000,00 EUR
AKT. DISPOSITIONSBETRAG: 1.000.000.000,00 EUR AUS CASH FORECAST









-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B79304E4 -- 03/02/09 -- 14:07:13 --

PF1:Hilfe  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

6.1.1.1.3 (C) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
GELDKONTO	Hier wird das Unterkonto definiert, für das der Reservierungsauftrag eingestellt werden soll. Es kann das Geldverrechnungskonto 220 oder ein Fundingkonto 221 – 229 eingegeben werden. Die 4-stellige Banknummer zieht sich automatisch aus der User-ID. Das Feld ist vorbelegt mit dem Geldverrechnungskonto.
TAG DER GELDVERRECHNUNG	Es wird das Valutadatum angezeigt, an dem der Reservierungsauftrag ausgeführt wird.
VERARBEITUNGSLAUF	Vorbelegt mit dem nächstfolgenden Verarbeitungslauf. Darüber hinaus kann die Voreinstellung mit den folgenden Kürzeln für alle anderen Verarbeitungsläufe überschrieben werden: • STD (Standard- und Realtime Standardverarbeitung) • C1F1 (Cont–SDS1, 1. Zyklus) • C1F2 (Cont–SDS1, 2. Zyklus) • C1F3 (Cont–SDS1, 3. Zyklus) • SDS1 • C2F1 (Cont–SDS2, 1. Zyklus) • C2F2 (Cont–SDS2, 2. Zyklus) • SDS2
RESERVIERUNGSFRIST	Es werden Datum und Uhrzeit angezeigt, bis wann der Reservierungsauftrag für den gewählten Verarbeitungslauf erteilt werden kann.
ANFORDERUNG	Hier ist der Betrag einzugeben, der für den gewählten Zyklus reserviert werden soll.
AKT. DISPOSITIONSBETRAG	Hier wird zur Information der Liquiditätsbedarf für den oben angegebenen Verarbeitungslauf angezeigt. Der Betrag basiert auf dem aktuellen Cash Forecast. Es erscheint nur dann ein Betrag, wenn der Cash Forecast einen Bedarf errechnet. Errechnet der Cash Forecast einen positiven Betrag, wird 0 ausgewiesen.

6.1.1.1.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

USER-ID / GELDKONTO

Jeweils die ersten vier Stellen der User-ID und des Geldkontos müssen über das CBF-Stammdatensystem verbunden bzw. zugeordnet sein.

GELDKONTO / ZENTRALBANK-KONTO

Das Zentralbank-Konto muss über das CBF-Stammdatensystem dem Geldkonto zugeordnet sein.

6.1.1.2 Erfassung von Reservierungsdaueraufträgen (DR)

6.1.1.2.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Für die tägliche, automatische Erzeugung von Reservierungsaufträgen kann der Kunde für jeden Zyklus einen entsprechenden Dauerauftrag an CBF erteilen. Daueraufträge können sowohl für Geldverrechnungskonten als auch für Fundingkonten erteilt werden.

Hinweis:

Nach Eingabe des Funktionscodes "DR" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung angezeigt.

6.1.1.2.2 (B) Eingabemaske Dauerreservierungsauftrag

```
TRAN: KNEE FC: DR SB:

DAUERAUFTRAG RESERVIERUNG   E R F A S S U N G

GELDKONTO: 7930 220
NÄCHSTE GENERIERUNG FÜR: 26.03.2010 VERARBEITUNGSLAUF: ____
ÄNDERUNG MÖGLICH BIS   :                 UHR

OPTIONSAUSWAHL:          _ (1 - FESTBETRAG, 2 - AKT. DISPOSITIONSBETRAG)
 OPTION 1: ANFORDERUNG   = ____________________  EUR (FESTBETRAG)

 OPTION 2: ANFORDERUNG   = AKTUELLER DISPOSITIONSBETRAG
 ZUSÄTZLICHE ANPASSUNG : + ___ %
                         +                      EUR
   MAXIMALE ANFORDERUNG:   ____________________  EUR









-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B793058R -- 25/03/10 -- 13:10:28 --

PF1:Hilfe  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

6.1.1.2.3 (C) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
GELDKONTO	Hier wird das Unterkonto definiert, für das der Dauerauftrag eingestellt werden soll. Es kann das Geldverrechnungskonto 220 oder die Fundingkonten 221 – 229 eingegeben werden. Die 4-stellige Banknummer zieht sich automatisch aus der User-ID. Das Feld ist vorbelegt mit dem Geldverrechnungskonto.
OPTIONSAUSWAHL	1 = Reservierung eines festen Betrages der manuell zu erfassen ist 2 = Reservierung des im Cash Forecast errechneten Liquiditätsbedarfs Ist unter Geldkonto ein Fundingkonto eingetragen, so ist nur Option 1 zulässig.
OPTION 1: ANFORDERUNG (bei OPTION 1)	Ist in der Optionsauswahl „1" eingestellt worden, so ist in diesem Feld der Festbetrag einzugeben, über den täglich eine Reservierungsanforderung generiert werden soll. Maximaler Betrag: EUR 999.999.999.999,99.
OPTION 2: ANFORDERUNG (bei OPTION 2)	Wurde bei der Optionsauswahl „2" eingegeben, so wird eine Reservierungsanforderung auf den im Cash Forecast errechneten Liquiditätsbedarf direkt vor Beginn eines Geldzyklus generiert. Dieser Betrag kann zusätzlich angepasst werden.
ZUSAETZLICHE ANPASSUNG	Bei Wahl der Option 2 kann ein Puffer angegeben werden, der zusätzlich zu dem im Cash Forecast errechneten aktuellen Dispositionsbetrag reserviert wird. Dieser Puffer setzt sich zusammen aus: • Einem bestimmten Prozentsatz (-99% bis 999%) des auf Basis des Cash Forecast errechneten aktuellen Dispositionsbetrags und • einem bestimmten Festbetrag in Euro. Bei einem negativen Cash Forecast Betrag wird der Puffer zusätzlich zu dem aktuelle Dispositionsbetrag reserviert. Ist der Cash Forecast Betrag positiv, aber kleiner als der Anpassungsbetrag, wird nur die Differenz zwischen den beiden Beträgen reserviert. Ist der positive Cash Forecast Betrag höher als der Anpassungsbetrag, erfolgt keine Reservierung.
MAXIMALE ANFORDERUNG	Bei Verwendung von Option 2 kann der maximale Anforderungsbetrag als zusätzliches Anpassungskriterium eingegeben werden. Der auf Basis der Cash Forecast Daten (Akt. Dispositionsbetrag + Anpassung in % +/- Festbetrag in Euro) generierte Reservierungsauftrag kann diesen maximalen Anforderungsbetrag in Euro nicht übersteigen. Wenn der errechnete Betrag niedriger als der maximale Anforderungsbetrag ist, wird der errechnete Betrag als angeforderter Betrag eingesetzt. Wenn aber der errechnete Betrag höher als der maximale Anforderungsbetrag ist, wird der maximale Anforderungsbetrag als angeforderter Betrag eingesetzt.
ERSTE AUSSFÜHRUNG	Das Feld ist vorbelegt mit dem Geschäftstag, an dem der Dauerauftrag erstmalig ausgeführt wird. Je nach Eingabezeitpunkt und Verarbeitungslauf, kommt der Dauerauftrag entweder noch am selben oder am nächsten Tag zum Tragen. Das Datum kann nicht überschrieben werden.

6.1.1.2.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

USER-ID / GELDKONTO

Jeweils die ersten vier Stellen der User-ID und des Geldkontos müssen über das CBF-Stammdatensystem verbunden bzw. zugeordnet sein.

6.1.1.3 Erfassung der Geldkontenverknüpfung (DW)

6.1.1.3.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Der Inhaber eines Fundingkontos (Unterkontonummer 221-229) kann in dieser Maske eingeben, mit welchem Geldverrechnungskonto das Fundingkonto verknüpft werden soll. Das heißt es wird festgelegt, an welches Geldverrechnungskonto (Unterkonto 220) die auf dem Fundingkonto reservierte Liquidität weitergeleitet werden soll.

Hinweis:

Die Erfassung von Geldkontenverknüpfungen zwischen Fundingkonten und Geldverrechnungskonten ist nur in der Zeit zwischen SDS2 und STD (ca. 13:40 bis 19:00 Uhr) möglich.

Nach Eingabe des Funktionscodes "DW" in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

6.1.1.3.2 (B) Eingabemaske Geldkontenverknüpfung

```
TRAN: KNEE FC: DW SB:

DAUERAUFTRAG ZUR GELDKONTENVERKNÜPFUNG / E R F A S S U N G


KONTO  SOLL: ____ ___
KONTO HABEN: ____ ___

BETRAG: DURCH ZENTRALBANK BESTÄTIGTER BETRAG




ERSTE AUSFÜHRUNG (TAG DER GELDVERRECHNUNG): 04.02.2009




-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B79304E4 -- 03/02/09 -- 14:08:36 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

6.1.1.3.3 (C) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
KONTO SOLL	Hier ist die Unterkontonummer des entsprechenden Fundingkontos einzugeben. Die Banknummer zieht das System automatisch aus der User-ID.
KONTO HABEN	Die Nummer (Stamm- und Unterkontonummer 220) des Geldverrechnungskontos ist einzugeben, an das die auf dem Fundingkonto reservierte Liquidität übertragen werden soll. *ACHTUNG*: Der Inhaber des Geldverrechnungskontos muss den Auftrag bestätigen (siehe Priorisierung der Geldquellenverwendung).
ERSTE AUSFÜHRUNG	Das Feld ist vorbelegt mit dem folgenden Geschäftstag. Es kann nicht überschrieben werden.

6.1.1.3.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

USER-ID / KONTO SOLL

Jeweils die ersten vier Stellen der User-ID und des Geldkontos müssen über das CBF-Stammdatensystem verbunden bzw. zugeordnet sein.

6.1.1.4 Erfassung der Priorisierung der Geldquellenverwendung (DP)

6.1.1.4.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Diese Maske ist von dem Inhaber des Geldverrechnungskontos 220 auszufüllen. Er kann die von dem Inhaber des Fundingkontos eingestellte Verknüpfung akzeptieren oder ablehnen und Prioritäten für die Nutzung der Geldquellen vergeben.

Hinweis: Die Erfassung der Priorisierung der Geldquellenverwendung ist nur in der Zeit zwischen SDS2 und STD (ca. 13:40 bis 19:00 Uhr) möglich.

Nach Eingabe des Funktionscodes „DP" und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

6.1.1.4.2 (B) Eingabemaske Priorisierung der Geldquellenverwendung

```
TRAN: KNEE FC: DP SB:

DAUERAUFTRAG GELDQUELLENPRIORISIERUNG / E R F A S S U N G

SETTLEMENT-GELDKONTO: ____

PRIO A GELDQUELLE NAME
__   _ ____ ___

__   _ ____ ___
__   _ ____ ___

__   _ ____ ___

ERSTE AUSFÜHRUNG (TAG DER GELDVERRECHNUNG): 04.02.2009




-- ID-KZ: 79300000001 -- PW:          ------ B79304E4 -- 03/02/09 -- 14:09:23 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

6.1.1.4.3 (C) Feldbesonderheiten

In der Eingabemaske erscheinen automatisch das Geldverrechnungskonto und alle mit ihm verknüpften Fundingkonten in numerischer Reihenfolge.

	Feldinhalt
SETTLEMENT-GELDKONTO	Das Feld ist vorbelegt mit dem Geldverrechnungskonto. Die Kontonummer zieht das System automatisch aus der User-ID.
PRIO	Die Priorität, nach der die Geldquellen für die Wertpapierabwicklung genutzt werden soll, wird für jedes Konto durch die Zahl (2-stellig) definiert, die vor dem entsprechenden Konto eingegeben wird. 01 – höchste Priorität 02 – zweithöchste Priorität etc. Nach Verarbeitung der Eingaben werden die Konten in der Reihenfolge der gesetzten Prioritäten aufgelistet.
A (=Annahme)	Hier ist anzugeben, ob die Verknüpfung zu dem angegebenen Fundingkonto akzeptiert wird oder nicht (siehe Dauerauftrag Geldkontoverknüpfung). J – Ja: angenommen N – Nein: nicht angenommen Die Annahme für das eigene Geldverrechnungskonto ist nicht abänderbar, das Feld ist automatisch mit „J“ belegt. Die Fundingkonten können nur für die Reservierung genutzt werden, wenn sie mit einem „J“ versehen sind.
ERSTE AUSFÜHRUNG	Das Feld ist vorbelegt mit dem folgenden Geschäftstag. Es kann nicht überschrieben werden.

6.1.1.4.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

USER-ID / SETTLEMENT GELDKONTO

Jeweils die ersten vier Stellen der User-ID und des Geldkontos müssen über das CBF-Stammdatensystem verbunden bzw. zugeordnet sein.

6.1.1.5 Erfassung von Daueraufträgen für die Marktregel bei Liquiditätsunterdeckung (DM)

6.1.1.5.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Die Marktregel (für ausländische Märkte) steuert im Falle einer Liquiditätsunterdeckung die verfügbare Liquidität für die drei ESES-Märkte Frankreich, Niederlande und Belgien sowie für den Domestic Market Deutschland und sorgt damit für eine effiziente und flexible Gelddisposition. Standardmäßig verarbeitet CBF die Marktregel automatisch auf Basis der Pro-Rata-Option.

Der Inhaber eines Geldverrechnungskontos (xxxx 220) hat die Möglichkeit einen Marktregel-Dauerauftrag zu erteilen, bei welchem er zwischen den Einstellungen "Pro-Rata-Option" und "Priorisierungs-Option" wählen kann. Nach Eingabe des Funktionscodes "DM" und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

6.1.1.5.2 (B) Eingabemaske Marktregel bei Liquiditätsunterdeckung

```
TRAN: KNEE FC: DM SB:

DAUERAUFTRAG FÜR MARKTREGEL BEI LIQUIDITÄTSUNTERDECKUNG
GELDKONTO: ____ ___                                  E R F A S S U N G
NÄCHSTE GENERIERUNG FÜR: 11.08.2011 VERARBEITUNGSLAUF: STD
ÄNDERUNG MÖGLICH BIS   : 10.08.2011 19:00 UHR

OPTIONSAUSWAHL: 2 (1 - ANTEILIG BEI UNTERDECKUNG, 2 - NACH PRIORITÄT)
PRIO A GELDKONTO  NAME
__   _ ____ ___

__   _ ____ ___
__   _ ____ ___









-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79303FX -- 10/08/11 -- 13:51:24 --

PF1:Hilfe  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

6.1.1.5.3 (C) Feldbesonderheiten

In der Eingabemaske erscheinen automatisch das Geldverrechnungskonto und alle mit ihm verknüpften Marktzuweisungskonten in numerischer Reihenfolge.

	Feldinhalt
GELDKONTO	Das Feld ist vorbelegt mit dem Geldverrechnungskonto. Die Kontonummer zieht das System automatisch aus der User-ID.
OPTIONSAUSWAHL	1 = "Pro-Rata-Option", d. h. im Falle einer Liquiditätsunterdeckung wird die bereitgestellte Liquidität gemäß dem Verhältnis der errechneten Dispositionsbeträge im Cash Forecast den einzelnen Märkten zugeteilt. 2 = "Priorisierungs-Option", d. h. es wird die Reihenfolge der Märkte festgelegt, nach der die bereitgestellte Liquidität, gemäß den im Cash Forecast pro Markt errechneten Dispositionsbeträgen, zugeteilt werden soll. Das Feld ist mit der Standardeinstellung 1 vorbelegt.
PRIO	Die Priorität, nach der die Liquidität den einzelnen Märkten / Konten zugeteilt werden soll, wird durch eine fortlaufende Nummerierung definiert. Die zweistelligen Zahlen sind vor dem entsprechenden Konto einzutragen. 01 – höchste Priorität 02 – zweithöchste Priorität etc. Nach Verarbeitung der Eingaben werden die Konten in der Reihenfolge der gesetzten Prioritäten aufgelistet.
A (= Aktivitäts-KZ)	Mit dem Aktivitäts-Kennzeichen kann die Geldbereitstellung bzw. – zuordnung für ein oder mehrere ausländische Märkte ausgeschlossen werden. J = Ja, d. h. aktiv N = Nein, d. h. nicht aktiv Der Ausschluss für das eigene Geldverrechnungskonto, d. h. die Geldbereitstellung bzw. -zuweisung im Domestic Market Deutschland, ist nicht abänderbar. Das Feld ist automatisch mit „J“ belegt.

6.1.1.5.4 (D) Abhängigkeitsprüfungen

USER-ID / SETTLEMENT GELDKONTO

Jeweils die ersten vier Stellen der User-ID und des Marktzuweisungskontos müssen über das CBF-Stammdatensystem verbunden bzw. zugeordnet sein.

6.1.2 Auftragsbearbeitung (EA)

Erfasste Einzelreservierungs- oder Dauerreservierungsaufträge können abgeändert oder gelöscht werden. Es können sowohl bereits belegte Feldinhalte überschrieben als auch leere Felder gefüllt werden.

Nach Eingabe des Transaktionscodes "KNEA" und anschließender Datenfreigabe wird ein Auswahlmenü angezeigt.

Mögliche Funktionen (FC):

- „AN" = Änderung eines Einzelreservierungsauftrags
- „LN" = Löschung eines Einzelreservierungsauftrags
- „DA" = Änderung eines Dauerauftrags
- „DL" = Löschen eines Dauerauftrages

```
TRAN: KNEA FC:    SB: ##04.02.2009#

GELDAUFTRÄGE         Ä N D E R U N G / L Ö S C H U N G

      EINZELAUFTRÄGE
      AN   ÄNDERN RESERVIERUNG
      LN   LÖSCHEN RESERVIERUNG

      DAUERAUFTRÄGE
      DA   ÄNDERN DAUERAUFTRAG
      DL   LÖSCHEN DAUERAUFTRAG



      ZUSÄTZLICHE AUSWAHL:
       GELDKONTO              : ____ ___

       TAG DER GELDVERRECHNUNG: 04.02.2009  ( BIS: __________ )
       VERARBEITUNGSLAUF      : ____


-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B79304E4 -- 03/02/09 -- 14:09:54 --
KN1502F Feld muss einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF1:Hilfe  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Durch die Eingabe eines der aufgeführten Funktionscodes und die Belegung der Feldinhalte in der Auswahlmaske können die Reservierungsaufträge bzw. Reservierungsdaueraufträge selektiert werden, die geändert bzw. gelöscht werden sollen.

6.1.2.1.1 (C) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
GELDKONTO	Es kann die Unterkontonummer des Geldverrechnungskontos oder des Fundingkontos eingegeben werden, für das die Aufträge eingestellt bzw. erzeugt wurden. Erfolgt keine Selektion werden die Aufträge für alle vorhandenen Geldkonten angezeigt. Die Banknummer zieht das System automatisch aus der User-ID.
TAG DER GELDVERRECHNUNG	Das Feld ist vorbelegt mit dem aktuellen Datum, bzw. dem Datum des folgenden Arbeitstags
VERARBEITUNGSLAUF	Wird hier keine Eingabe gemacht, werden alle vorhandenen Reservierungsaufträge oder Daueraufträge für alle Zyklen angezeigt. Die Aufträge für bestimmte Verarbeitungsläufe können durch Eingabe der folgenden Kürzel gezielt aufgerufen werden. • STD (Standard- und Realtime Standardverarbeitung) • C1F1 (Cont–SDS1, 1. Zyklus) • C1F2 (Cont–SDS1, 2. Zyklus) • C1F3 (Cont–SDS1, 3. Zyklus) • SDS1 • C2F1 (Cont–SDS2, 1. Zyklus) • C2F2 (Cont–SDS2, 2. Zyklus) • SDS2

6.1.2.1.2 (D) Abhängigkeitsprüfungen

USER-ID / SETTLEMENT GELDKONTO

Jeweils die ersten vier Stellen der User-ID und des Geldkontos müssen über das CBF-Stammdatensystem verbunden bzw. zugeordnet sein.

6.1.2.2 Ändern Reservierung (AN)

6.1.2.2.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Änderungsfunktion KNEA/AN (ändern Reservierung) werden alle in der Auswahlmaske selektierten Einzelreservierungsaufträge aufgerufen. Aus der Liste dieser Aufträge kann durch Eingabe eines „X“ und Drücken der Enter-Taste der Auftrag ausgewählt werden, der geändert werden soll:

6.1.2.2.2 (B) Vollanzeige/Ändern Reservierung

```
TRAN: KNEA FC: AN SB: 7930#220#16.02.2010#

 RESERVIERUNGSAUFTRAG / I N F O R M A T I O N

 GELDKONTO: 7930 220 TESTBANK AG

 TAG DER GELDVERRECHNUNG: 16.02.2010 VERARBEITUNGSLAUF: SDS2
 RESERVIERUNGSFRIST:      16.02.2010 13:15 UHR



 ANFORDERUNG            :          800.000,00  EUR  (HABEN)
 AKT. DISPOSITIONSBETRAG:          204.442,50  EUR  (HABEN)



 STATUS  :  150 GÜLTIG ERTEILT                          ZULETZT BEARBEITET
                                                        7930060001
 URSPRUNG:  MANUELL ERTEILT                             DATUM       ZEIT
                                                        16.02.2010  11:57

 -- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B79304E4 -- 16/02/10 -- 11:59:36 --

 PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Änderbares Feld:

Anforderung: Der ursprünglich eingestellte Reservierungsbetrag kann überschrieben werden. Durch Drücken der F3-Taste wird die Änderung verarbeitet.

Hinweis:

Eine Auflistung der möglichen Status-Ausprägungen findet sich im Band 2, Abschnitt 7.2 wieder.

6.1.2.3 Ändern Dauerauftrag (DA)

6.1.2.3.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Änderungsfunktion KNEA/DA (ändern Dauerauftrag) werden alle in der Auswahlmaske selektierten Daueraufträge aufgerufen. Aus der Liste dieser Daueraufträge kann durch Eingabe eines „X" und Drücken der Enter-Taste der Auftrag ausgewählt werden, der geändert werden soll:

6.1.2.3.2 (B) Vollanzeige/Ändern Dauerauftrag

```
TRAN: KNEA FC: DA SB: 7930#220#04.02.2009#

DAUERAUFTRAG RESERVIERUNG / Ä N D E R U N G

GELDKONTO: 7930 220  TESTBANK AG
NÄCHSTE GENERIERUNG FÜR: 04.02.2009 VERARBEITUNGSLAUF: STD
ÄNDERUNG MÖGLICH BIS   : 03.02.2009 19:00 UHR

OPTIONSAUSWAHL:          1 (1 - FESTBETRAG, 2 - AKT. DISPOSITIONSBETRAG)
 OPTION 1: ANFORDERUNG   =             1.000,00  EUR (FESTBETRAG)

 OPTION 2: ANFORDERUNG   = AKTUELLER DISPOSITIONSBETRAG
 ZUSÄTZLICHE ANPASSUNG : + ___ %
                         +                       EUR
   MAXIMALE ANFORDERUNG:   ____________________  EUR

STATUS  :  150 GÜLTIG ERTEILT                            ZULETZT BEARBEITET
                                                         7930260001
                                                         DATUM       ZEIT
                                                         03.02.2009  14:13

-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B79304E4 -- 03/02/09 -- 14:14:25 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Änderbares Feld:

Die Änderungsmasken entsprechen inhaltlich den Erfassungsmasken für die jeweiligen Daueraufträge KNEE/DP, KNEE/DW, KNEE/DR und KNEE/DM.

In dieser *Vollanzeige* können jetzt die vorgesehenen *Änderungen* eingegeben werden. Neben der Prüfung, ob alle Mussfelder vorhanden sind, werden die Eingaben auf formale Richtigkeit und auf gültige Abhängigkeiten zueinander geprüft. Es werden dieselben Plausibilitäten wie in der Erfassung angewandt.

Nach der Verarbeitung mit F3 kehrt das System zur tabellarischen Kurzanzeige zurück, in der der Benutzer den nächsten zu ändernden Auftrag auswählen kann.

6.1.2.4 Löschen Reservierung (LN)

6.1.2.4.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Löschfunktion KNEA/LN (löschen Reservierung) werden alle in der Auswahlmaske selektierten Einzelreservierungsaufträge aufgerufen. Die selektierten Aufträge erscheinen in einer Tabelle und werden durch Markierung des entsprechenden Auftrags mit „X“ und anschließender Verarbeitung mit der F3-Taste gelöscht, ohne dass der Auftrag noch einmal im Detail angezeigt wird.

Eine detaillierte Anzeige des Auftrages ist durch Eingabe eines „I“ und Drücken der Enter-Taste möglich.

6.1.2.4.2 (B) Tabellarische Anzeige/Löschen Reservierung

```
TRAN: KNEA FC: LN SB: 7930##04.02.2009#

GELDAUFTRÄGE     L Ö S C H U N G

                                                                    SEITE   1
  TAG DER
K GELDVERR.LAUF FRIST TYP      KTO-SOLL  KTO-HABEN         BETRAG IN EUR  VS
-------------------------------------------------------------------------------
_ 04.02.09 STD  19:00 RESERV             7930 220             100.000,00  150









-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B79304E4 -- 03/02/09 -- 14:17:11 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (K):

"I"= Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

"X"= Löschung des Auftrages mit PF3-Taste

6.1.2.4.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es darf jeweils nur *ein „I"* auf einer Maskenseite eingegeben werden, da nur ein Auftrag zur Vollanzeige selektiert werden kann.

6.1.2.5 Löschen Dauerauftrag (DL)

6.1.2.5.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Löschfunktion KNEA/DL (löschen Dauerauftrag) werden alle in der Auswahlmaske selektierten Daueraufträge aufgerufen. Die selektierten Daueraufträge erscheinen in einer Tabelle und werden durch Markierung des entsprechenden Auftrags mit „X" und anschließender Verarbeitung mit der F3-Taste gelöscht, ohne dass der Auftrag noch mal im Detail angezeigt wird.

Eine detaillierte Anzeige des Dauerauftrages ist durch Eingabe eines „I" und Drücken der Enter-Taste möglich.

Die Masken entsprechen weitestgehend den Masken zur Löschung von Einzelaufträgen, daher wird hier auf ein Bespiel verzichtet.

6.1.3 Information Geldaufträge (GI)

Im Informationsdienst können sich Teilnehmer selbst eingestellte Reservierungseinzelaufträge und Daueraufträge, sowie die von CBF automatisch generierten Reservierungsaufträge anzeigen lassen. Es besteht *nicht* die Möglichkeit, von hier aus Änderungen vorzunehmen oder Aufträge zu löschen.

Durch die Eingabe eines der aufgeführten Funktionscodes und die Belegung der Feldinhalte in der Auswahlmaske können die Geldaufträge gezielt selektiert werden. Wenn keine Selektion erfolgt, werden alle Aufträge innerhalb des gewählten Funktionscodes angezeigt, die im System hinterlegt sind.

6.1.3.1.1 (A) Auswahlmaske Information

```
TRAN: KNGI FC:   SB: ##28.01.2010#

AUFTRAGSABWICKLUNG GELD FÜR SETTLEMENT    I N F O R M A T I O N

          IG   AUFTRÄGE
          ID   DAUERAUFTRÄGE


ZUSÄTZLICHE  AUSWAHL:

 GELDKONTO              : ____ ___

 TAG DER GELDVERRECHNUNG: 28.01.2010 ( BIS: __________ )
 VERARBEITUNGSLAUF      : ____

 AUFTRAGSART            : __
 STATUS                 : ___




-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B793058R -- 27/01/10 -- 16:46:34 --

PF1:Hilfe  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

6.1.3.1.2 (B) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
GELDKONTO	Es kann die Unterkontonummer eines Geldverrechnungskontos, eines Fundingkontos oder eines Marktzuweisungskontos eingegeben werden, für das die Aufträge eingestellt bzw. erzeugt wurden. Erfolgt keine Selektion werden die Aufträge für alle vorhandenen Geldkonten angezeigt. Die Banknummer zieht das System automatisch aus der User-ID.
TAG DER GELDVERRECHNUNG	Hier besteht die Möglichkeit, die Suche auf einen bestimmten Zeitraum (max. 40 Tage) einzugrenzen. Das Feld ist mit dem aktuellen Datum vorbelegt.
VERARBEITUNGSLAUF	Wird hier keine Angabe gemacht, werden alle vorhandenen Aufträge für alle Zyklen angezeigt. Die Aufträge für bestimmte Verarbeitungsläufe können durch Eingabe des entsprechenden Kürzels (siehe Hilfemaske) gezielt aufgerufen werden.
AUFTRAGSART	Wird hier keine Angabe gemacht, werden die Aufträge aller Auftragsarten angezeigt. Die Aufträge für bestimmte Auftragsarten können durch Eingabe des entsprechenden Kürzels (siehe Hilfemaske) gezielt aufgerufen werden.
STATUS	Wird hier keine Angabe gemacht, werden die Aufträge mit allen Statusausprägungen angezeigt. Sollen nur Aufträge mit einem bestimmten Statusausprägung angezeigt werden, können sie durch die Eingabe der entsprechenden 3-stelligen Statusnummer (siehe CASCADE Handbuch Band 2, Abschnitt 7.2, Status Geldauftrag Euro) selektiert werden.

6.1.3.1.3 (C) Abhängigkeitsprüfungen

USER-ID / SETTLEMENT GELDKONTO

Jeweils die ersten vier Stellen der User-ID und des Geldkontos müssen über das CBF-Stammdatensystem verbunden bzw. zugeordnet sein.

6.1.3.1.4 (D) Hilfemaske

Die Kürzel für die unterschiedlichen Auftragsarten zum Abruf von Geldaufträgen (KNGI/IG) oder Daueraufträgen (KNGI/ID) sind auf einer Hilfemaske, die über F1 abrufbar ist, hinterlegt.

```
TRAN: KNGI FC:    SB: ##08.08.2011#

AUFTRAGSABWICKLUNG GELD     H I L F E

        BEARBEITUNGSFRIST      AUFTRAGSART (NUR RELEVANT FÜR TRAN: KNGI)
        FÜR RESERVIERUNGEN
 LAUF   UND DAUERAUFTRÄGE      BEI GELDAUFTRÄGEN (TRAN: KNGI FC: IG)
                                 R - RESERVIERUNG
 STD       19:00                 E - EINZUG
 C1F1       7:10                 A - AUSZAHLUNG
 C1F2       8:00                 W - ÜBERTRAG FUNDING-KONTO -> GELDKONTO
 C1F3       9:00                 P - ÜBERTRAG GELDKONTO -> FUNDING-KONTO
                                 X - CROSS CSD TRANSFER
 SDS1      10:00                 M - MARKT TRANSFER GELDKONTO -> MARKTKONTO
                                 N - MARKT RÜCKTRANSFER MARKTKONTO -> GELDKTO
 C2F1      10:45                BEI DAUERAUFTRÄGEN (TRAN: KNGI FC: ID)
 C2F2      12:00                 DR - DAUERAUFTRAG RESERVIERUNG
                                 DW - GELDKONTENVERKNÜPFUNG
 SDS2      13:15                 DP - GELDQUELLENPRIORISIERUNG
                                 DM - DAUERAUFTRAG MARKTREGEL

-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79303FX -- 05/08/11 -- 12:15:46 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

6.1.3.2 Geldaufträge (IG)

6.1.3.2.1 (A) Auswahl Geldaufträge

Zur Abfrage von verarbeiteten Geldaufträgen kann innerhalb der Transaktion KNGI der Funktionscode IG genutzt werden. Durch Selektion eines Geldkontos, des Tages der Geldverrechnung, des Verarbeitungslaufs, der Auftragsart und des Status kann die Anzahl der angezeigten Geldaufträge eingeschränkt werden.

In der Folgemaske werden alle selektierten Aufträge tabellarisch angezeigt.

```
TRAN: KNGI FC: IG SB: 7930#220#08.08.2011#

GELDAUFTRÄGE FüR SETTLEMENT      I N F O R M A T I O N

                                                                    SEITE   1
  TAG DER
K GELDVERR.LAUF FRIST TYP      KTO-SOLL  KTO-HABEN         BETRAG IN EUR  VS
-------------------------------------------------------------------------------
  08.08.11 STD  19:00 RESERV             7930 220                  2,55  350
_ 08.08.11 STD        MARKT-TR 7930 220  7930 260                  1,70  350
_ 08.08.11 STD        MARKT-TR 7930 220  7930 262                  0,85  350
  08.08.11 STD        MARKT-TR 7930 260  7930 220                  1,70  350
_ 08.08.11 STD        MARKT-TR 7930 262  7930 220                  0,85  350
_ 08.08.11 STD        RERÜCK   7930 220                           2,55  350









-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79303FX -- 08/08/11 -- 11:13:42 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

6.1.3.2.2 (B) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
K	Das Kennzeichen in der ersten Spalte (K) gibt den Bearbeitungsstand des Auftrages an. " " = nicht markierter Auftrag "F" = fehlerhafter Auftrag "A" = aus dem Auftragsstatus zum Ändern generiert "L" = aus dem Auftragsstatus zum Löschen generiert Wird das Feld K mit „I" überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Verzweigung in die Vollanzeige des entsprechenden Auftrags
GELDVERR.	Datum des Tages der Geldverrechnung
LAUF	Kürzel des Verarbeitungslaufs, für den der Auftrag eingestellt bzw. generiert wurde
FRIST	Uhrzeit, wann der Auftrag zur Ausführung kommt
TYP	Typ der Geldinstruktion, folgende Ausprägungen sind möglich: • RESERV: Reservierungsauftrag • RERÜCK: Rückbuchungsauftrag des ursprünglichen Reservierungsbetrags • AUSZ: Saldo auf dem Verarbeitungslauf, Betrag, der an den Kunden ausgezahlt wird • EINZ: Saldo auf dem Verarbeitungslauf, Betrag, der vom RTGS-Unterkonto des Kunden eingezogen wird • ÜBERTRAG: Transfer von reservierter Liquidität vom Fundingkonto auf das Geldverrechnungskonto oder umgekehrt • X-CSD: Betrag, der vom RTGS-Unterkonto des Kunden eingezogen und auf das RTGS Konto des ausl. CSD transferiert wird. • MARKT-TR: Transfer von reservierter Liquidität von einem Marktzuweisungskonto auf das Geldverrechnungskonto oder umgekehrt.
KTO-SOLL	Geldverrechnungs-, Funding- oder Marktzuweisungskonto, das belastet wird
KTO-HABEN	Geldverrechnungs-, Funding- oder Marktzuweisungskonto, das gutgeschrieben wird
BETRAG IN EUR	Geldbetrag in Euro, der reserviert, eingezogen, ausgezahlt oder zwischen Geldverrechnungs- und Fundingkonto bzw. zwischen Geldverrechnungs- und Marktzuweisungskonto übertragen wurde
VS	Aktueller Verarbeitungsstatus des Geldauftrages (Ausprägungen siehe auch CASCADE Handbuch Band 2, Abschnitt 7.2, Status Geldauftrag Euro)

6.1.3.2.3 (C) Vollanzeige eines Reservierungsauftrags/Information

Die Detailanzeige entspricht inhaltlich weitgehend der Maske zur Eingabe oder Änderung eines einzelnen Reservierungsauftrags (siehe KNEE, KNEA). Zusätzlich werden folgende Informationen angezeigt:

```
TRAN: KNGI FC: IG SB: 7930#220#25.03.2010#C1F2

RESERVIERUNGSAUFTRAG / I N F O R M A T I O N

GELDKONTO: 7930 220 TESTBANK AG

TAG DER GELDVERRECHNUNG: 25.03.2010 VERARBEITUNGSLAUF: C1F2
RESERVIERUNGSFRIST:      25.03.2010 08:00 UHR

RTGS-KONTO             : BIC HABADEFFXXX  DEMARKSHABADEFFXXXDAKV03CBF7930220

ANFORDERUNG            :                0,00  EUR  (HABEN)
BLOCKIERTE LIQUIDITÄT  :       300.165.030,38  EUR  (HABEN)



STATUS  :  350 VERARBEITET                              ZULETZT BEARBEITET
                                                        CASCADE
URSPRUNG:  EXTERN ERTEILT                               DATUM       ZEIT
                                                        25.03.2010  08:06

-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B793058S -- 25/03/10 -- 13:30:27 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

6.1.3.2.4 (D) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
RTGS-KONTO	RTGS-Konto und –Unterkonto im TARGET2 System, über das die Reservierung vorgenommen wird
ANFORDERUNG	Betrag, aus dem Reservierungsauftrag, der an TAREGET2 übermittelt wurde. Bei Einzelreservierungsaufträgen entspricht die Anforderung dem Betrag, der vom Kunden dort eingestellt wurde. Bei Dauerreservierungsaufträgen entspricht der Betrag entweder dem dort eingestellten Festbetrag (Option 1) oder dem auf Basis des Cash Forecast errechneten Betrags inkl. der Anpassungen (Option 2). Ist der Betrag „0“, wurde keine Reservierungsanforderung von CASCADE-System generiert und an TARGET2 übermittelt. Hier kommt die Reservierungsbuchung nur deshalb zustande, weil entweder noch Liquidität (siehe Feld „blockierte Liquidität“) auf dem entsprechenden RTGS-Unterkonto aus vorangehenden Verarbeitungsläufen vorhanden war oder der RTGS-Kontoinhaber durch einen Liquiditätstransfer den Betrag direkt im TARGET2-System auf das RTGS-Unterkonto übertragen hat.
BLOCKIERTE LIQUIDITÄT	Betrag, der als reservierte Liquidität auf dem RTGS-Unterkonto zur Abwicklung im angegebenen Verarbeitungslauf zur Verfügung steht.
STATUS	Aktueller Verarbeitungsstatus des Geldauftrages (Ausprägungen siehe auch CASCADE Handbuch Band 2, Abschnitt 7.2, Status Geldauftrag Euro)
URSPRUNG	Information, wie der Auftrag in CASCADE eingestellt wurde; folgende Ausprägungen sind möglich: • MANUELL ERTEILT: Der Auftrag wurde als Einzelauftrag in CASCADE erfasst • DAUERAUFTRAG: Der Auftrag wurde von CBF automatisch auf Basis eines Dauerauftrags generiert • EXTERN ERTEILT: Die Reservierung wurde ohne CASCADE-Reservierungsauftrag auf Basis des Restsaldos auf dem RTGS-Unterkonto oder eines Liquiditätstransfers innerhalb des TARGET2-Systems gebucht
ZULETZT BEARBEITET	Information über die Quelle des Auftrags. Folgende Ausprägungen sind möglich: • CASCADE: der Auftrag bzw. die Buchung wurde von CASCADE automatisch generiert • 10-stellige CASCADE User-ID: der Auftrag wurde vom User mit der angegebenen USER-ID eingegeben
DATUM / ZEIT	Datum und Uhrzeit der letzten Bearbeitung bzw. der automatischen Generierung des Auftrages

6.1.3.2.5 (E) Vollanzeige eines Einzugs- bzw. Auszahlungsauftrages/Information

```
TRAN: KNGI FC: IG SB: 7930#220#25.03.2010#STD

EINZUGSAUFTRAG / I N F O R M A T I O N

GELDKONTO: 7930 220 TESTBANK AG

TAG DER GELDVERRECHNUNG: 25.03.2010 VERARBEITUNGSLAUF: STD


RTGS-KONTO             : BIC HABADEFFXXX  DEMARKSHABADEFFXXXDAKV03CBF7930220

BETRAG                 :       777.903.848,25  EUR  (HABEN)




STATUS  :  350 VERARBEITET                              ZULETZT BEARBEITET
                                                        CASCADE
URSPRUNG:  AUTOMATISCH GENERIERT                        DATUM       ZEIT
                                                        25.03.2010  06:05

-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B793058S -- 25/03/10 -- 13:34:17 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

6.1.3.2.6 (F) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
GELDKONTO	Es wird das Geldverrechnungskonto oder das Fundingkonto angezeigt, über das die Auszahlung (nur über Geldverrechnungskonten) oder der Einzug vorgenommen wird.
TAG DER GELDVERRECHNUNG	Datum an dem die Zahlung auf TARGET2 Seite erfolgt
VERARBEITUNGSLAUF	Verarbeitungslauf für den die Zahlung vorgenommen wird
RTGS-KONTO	RTGS-Konto und Sub-account im TARGET2 System, auf dem die Belastung bzw. Gutschrift erfolgt
BETRAG	EUR-Betrag, der gutgeschrieben bzw. eingezogen wird
STATUS	Aktueller Verarbeitungsstatus des Geldauftrages (Ausprägungen siehe auch CASCADE Handbuch Band 2, Abschnitt 7.2, Status Geldauftrag Euro)
URSPRUNG	Information, wie der Auftrag in CASCADE eingestellt wurde; folgende Ausprägungen sind möglich: • AUTOMATISCH GENERIERT: Einzugs- bzw. Auszahlungsaufträge werden in der Regel automatisch aus CASCADE heraus generiert
ZULETZT BEARBEITET	Information über die Quelle des Auftrags. Folgende Ausprägungen sind möglich: • CASCADE: Der Einzugsauftrag wird in der Regel automatisch aus CASCADE heraus generiert.
DATUM/ZEIT	Datum und Uhrzeit der automatischen Generierung des Auftrages

6.1.3.3 Daueraufträge (ID)

6.1.3.3.1 (A) Auswahl Daueraufträge

Zur Abfrage von eingestellten Daueraufträgen im Erfassungs- oder Auftragsstatus kann innerhalb der Transaktion KNGI der Funktionscode ID genutzt werden. Auch in dieser Auswahlmaske kann durch die Selektion eines Geldkontos, des Verarbeitungslaufs, der Auftragsart und des Status die Zahl der angezeigten Daueraufträge eingeschränkt werden.

In der Folgemaske werden alle selektierten Daueraufträge tabellarisch angezeigt. Darüber hinaus werden jeweils die Zykluskürzel und die entsprechenden Reservierungsfristen mit angezeigt (KNGI ID).

```
TRAN: KNGI FC: ID SB: ##01.08.2011#STD

DAUERAUFTRÄGE      I N F O R M A T I O N

                                                                  SEITE   4

K  LAUF FRIST TYP            KTO-SOLL  KTO-HABEN         BETRAG IN EUR   VS
-------------------------------------------------------------------------------
   STD  19:00 RESERVIERUNG             7931 220                        098
_  STD  19:00 RESERVIERUNG             7930 220                        150
   STD  19:00 MARKTREGEL     7931 220                                  150
_  STD  19:00 MARKTREGEL     7930 220                                  150
_             VERKNÜPFUNG    7931 221  7931 220                        150
              VERKNÜPFUNG    7930 221  7930 220                        150
_             PRIORISIERUNG  7931 220                                  150
_             PRIORISIERUNG  7930 220                                  150




-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79303FX -- 11/08/11 -- 12:52:12 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

6.1.3.3.2 (B) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
K	Das Kennzeichen in der ersten Spalte (K) gibt den Bearbeitungsstand des Auftrages an. " " = nicht markierter Auftrag "F" = fehlerhafter Auftrag "A" = aus dem Auftragsstatus zum Ändern generiert "L" = aus dem Auftragsstatus zum Löschen generiert Wird das Feld K mit "I" überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Verzweigung in die Vollanzeige des entsprechenden Auftrags
LAUF	Kürzel des Verarbeitungslaufs, für den der Auftrag eingestellt bzw. generiert wurde
FRIST	Uhrzeit, wann der Auftrag zur Ausführung kommt
TYP	Typ des Dauerauftrags, folgende Ausprägungen sind möglich: • RESERVIERUNG: Reservierungsdauerauftrag • MARKTREGEL: Liquiditätsmanagement für Geldverrechnung über TARGET2 mit Kontrahenten in Euroclear ESES Belgien, Frankreich oder Niederlande • VERKNÜPFUNG: Verknüpfung eines Fundingkontos (KTO-SOLL) mit einem Geldverrechnungskonto (KTO- HABEN) • PRIORISIERUNG: Priorisierung der Geldquellen bei Nutzung eines Fundingkontos
KTO-SOLL	Geldverrechnungs-, Funding- oder Marktzuweisungskonto, das belastet wird
KTO-HABEN	Geldverrechnungs-, Funding- oder Marktzuweisungskonto, das gutgeschrieben wird
BETRAG IN EUR	Geldbetrag in Euro, der reserviert, eingezogen, ausgezahlt oder zwischen Geldverrechnungs- und Fundingkonto bzw., zwischen Geldverrechnungs- und Marktzuweisungskonto übertragen wurde
VS	Aktueller Verarbeitungsstatus des Geldauftrages (Ausprägungen siehe auch CASCADE Handbuch Band 2, Abschnitt 7.2, Status Geldauftrag Euro)

6.1.3.3.3 (C) Vollanzeige eines Dauerauftrags Geldquellenpriorisierung

```
TRAN: KNGI FC: ID SB: 7930##25.03.2009#

DAUERAUFTRAG GELDQUELLENPRIORISIERUNG / I N F O R M A T I O N

SETTLEMENT-GELDKONTO: 7930 220  TESTBANK AG

PRIO A GELDQUELLE NAME                    STATUS    GRUND
01   J 7932 221   MUSTERBANK AG           AKTIV
02   J 7930 220   TESTBANK AG             INAKTIV - KEIN RTGS EINZUGSKONTO




ERSTE AUSFÜHRUNG (TAG DER GELDVERRECHNUNG): 23.11.2009

STATUS  :  150 GÜLTIG ERTEILT                          ZULETZT BEARBEITET
                                                       7930000001
                                                       DATUM       ZEIT
                                                       22.11.2009  16:21

-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B7930E4 -- 30/03/09 -- 14:11:28 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF9:Hist-Zurück
```

6.1.3.3.4 (D) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
SETTLEMENT GELDKONTO	Geldverrechnungskonto- oder Fundingkontonummer
Unterschiedliche Felder je nach Dauerauftragsart	Inhalte analog der Erfassungsmasken für die Dauerauftragsarten • Reservierung (siehe Eingabemaske KNEE/DA) • Verknüpfung (siehe Eingabemaske KNEE/DW) • Priorisierung (siehe Eingabemaske KNEE/DP)
STATUS	Aktueller Verarbeitungsstatus des Dauerauftrages
ZULETZT BEARBEITET	User ID des CASACDE Users, der den Dauerauftrag zuletzt bearbeitet hat
DATUM/ ZEIT	Datum und Zeit der letzten Bearbeitung durch den oben genannten CASCADE User

6.1.3.4 Cash Forecast – Konfiguration (AA)

Über die Transaktion KUAA kann der Kunde definieren, welche gesperrten Transaktionen für sein CBF-Konto bzw. für alle Geldverrechnungskonten, die seinem CBF-Konto zugeordnet sind, in den aktuellen Dispositionsbetrag des Cash-Forecast einfließen sollen. Die Cash Forecast Konfiguration wird bei der automatischen Generierung von Reservierungsanforderungen berücksichtigt, wenn der Kunde Reservierungsdaueraufträge auf Basis des Cash Forecast erteilt hat.

```
TRAN: KUAA FC: RA SB: ##

CASH FORECAST - AENDERN DER KONFIGURATION

RA   AENDERN DER KONFIGURATION FUER DEN CASH FORECAST (GELDKONTO)









GELDKONTO-NR:              ____ ___









-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B793058R -- 23/08/11 -- 13:36:06 --
AE0200F  Bitte HELL angezeigtes, leeres Feld ergänzen
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Nach Eingabe des Funktionscodes RA in dem Auswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Konfiguration des Cash Forecast aufgerufen. Das Geldkonto wird automatisch anhand der ersten vier Stellen der User-ID ermittelt. Eine Konfiguration kann nur für Geldverrechnungskonten vorgenommen werden, da für Fundingkonten kein Cash Forecast berechnet wird.

Geldregulierung in Euro

```
TRAN: KUAA FC: RA SB: 7930#220#

CASH FORECAST - KONFIGURATION / A E N D E R U N G

GELDKONTO: 7930 220   TESTBANK AG

                        KAUF   VERKAUF DIE ANGEKREUZTEN GESPERRTEN AUFTRAEGE
EIGENE SPERREN:            X           WERDEN IN DER ZEILE "SPERREN LT.REGEL"
FREMDE SPERREN:                        BERUECKSICHTIGT UND FLIESSEN IN DEN
 ALLE KONTRAHENTEN          _   _      AKTUELLEN DISPOSITIONSBETRAG UND SOMIT
                                       IN DIE RESERVIERUNG EIN (NUR BEI DAUER-
 ____                       _   _      AUFTRAG). AUSGENOMMEN HIERVON SIND AUF-
 ____                       _   _      TRAEGE VON "AUSLAENDISCHEN MAERKTEN"

 ____                       _   _    SELBSTBESICHERUNG BERUECKSICHTIGEN    : _
 ____                       _   _    BRUTTO DISPOSITIONSBETRAG (NUR KAEUFE): _
 ____                       _   _                          ZULETZT BEARBEITET      ____
 ____                       _   _                          DATUM       ZEIT
                                                           01.01.0001  00:00

-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B7930462 -- 23/08/11 -- 08:14:21 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Regel-zurück
```

In dieser Maske kann mittels Regeln definiert werden, welche gesperrten Geschäfte bei der Abwicklung berücksichtigt werden sollen. Es können sowohl eigene gesperrte Verkäufe (EIGENE SPERREN) als auch von Kontrahenten gesperrte Geschäfte (Käufe und Verkäufe) (FREMDE SPERREN) berücksichtigt werden. Bei der Berücksichtigung gesperrter Käufe erhöht sich der Liquiditätsbedarf entsprechend und bei der Berücksichtigung gesperrter Verkäufe verringert er sich entsprechend. Es ist zu beachten, dass Änderungen der Konfigurationsregel umgehend gültig werden und sofort zu einer Änderung der Berechnung des Dispositionsbetrags führen.

6.1.3.4.1 (C) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
GELDKONTO	Nummer des Geldverrechnungskontos bzw. die CBF-Kontonummer. Diese wird automatisch anhand der ersten vier Stellen der User ID ermittelt.
EIGENE SPERREN	Das Feld KAUF ist generell markiert, da sämtliche eigenen Käufe, die mit einer Settlementsperre belegt sind, immer in den aktuellen Dispositionsbetrag mit eingerechnet werden. Diese Regel ist voreingestellt und kann nicht verändert werden. Die eigenen, gesperrten Verkäufe werden in den Dispositionsbetrag mit eingerechnet, wenn das Feld unter VERKAUF mit „X“ markiert wird
FREMDE SPERREN	Hier kann definiert werden, welche vom Kontrahenten gesperrten Geschäfte mit in den Dispositionsbetrag eingerechnet werden. Die Angabe von KAUF und VERKAUF bezieht sich stets auf die eigene Sicht, nicht die des Kontrahenten. Wird die Regel FREMDE SPERREN – ALLE KONTRAHENTEN gewählt, gilt folgendes: • KAUF mit „X“ markiert: Alle vom Kontrahenten gesperrten Verkäufe (eigene Käufe) werden mit eingerechnet. • VERKAUF mit „X“ markiert: Alle vom Kontrahenten gesperrten Käufe (eigene Verkäufe) werden mit eingerechnet. Alternativ können die vom Kontrahenten gesperrten Geschäfte einzelner Kontrahenten (auf Kontoebene) definiert werden, die in den Dispositionsbetrag eingerechnet werden sollen. Dazu müssen die jeweiligen Kontonummern (4-stellige CBF-Kontonummer) der Kontrahenten in die Konfigurationsmaske eingetragen werden. Die Eingabe von Konten ist nur zulässig, wenn das Feld ALLE KONTRAHENTEN nicht markiert ist.
SELBSTBESICHERUNG BERÜCKSICHTIGEN	Teilnehmer an der Selbstbesicherung können zusätzlich bestimmen, ob die Summe aller Selbstbesicherungsgeschäfte (generierte Verkäufe) in den Dispositionsbetrag mit eingerechnet werden sollen. In diesem Fall muss das Feld mit „X“ markiert werden. Wird diese Option nicht gewählt, wird der Selbstbesicherungsbetrag in der Cash Forecast Übersicht nur zu Informationszwecken ausgewiesen.
BRUTTO DISPOSITIONSBETRAG (NUR KÄEUFE)	Diese Option bewirkt, dass die Berechnung des aktuellen Dispositionsbetrages auf Bruttobasis (nur Berücksichtigung von Käufen) durchgeführt wird. Auswahl durch Markierung des nebenstehenden Feldes mit „X“.
ZULETZT BEARBEITET	User ID des CASACDE Users, der die Konfiguration zuletzt bearbeitet hat
DATUM/ ZEIT	Datum und Zeit der letzten Bearbeitung durch obigen CASCADE User

6.1.3.5 Cash Forecast – Auswahlmenü (CF)

6.1.3.5.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Die Geldinformationen des Cash Forecast bieten die notwendigen Details zur Steuerung der Gelddisposition für die Wertpapierabwicklung. Der Cash Forecast kann für die zurückliegenden 132 Bankarbeitstage für jeden einzelnen Verarbeitungslauf abgerufen werden. Es wird der Stand zu Beginn des jeweiligen Zyklus angezeigt.

Ausgehend von dem Hauptauswahlmenü der CBF-Dienste (siehe Abschnitt 0) gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes „CF" zum Cash Forecast Auswahlmenü:

```
TRAN: KUCF FC:    SB: ##EUR#14.04.2015#STD

CASH FORECAST

CF   UEBERSICHT FUER GELDVERRECHNUNGSKONTO            (GELDKONTO)
RI   INFORMATION UEBER KONFIGURATION CASH FORECAST    (GELDKONTO)



DE   UEBERSICHT FUER CBF-KONTO                       (BANK)



BANK/GELDKONTO-NR:        ____ ___

TAG DER GELDVERRECHNUNG: 14.04.2015   (TT.MM.JJJJ)
VERARBEITUNGSLAUF:       STD      (NTS,C1F1,C1F2,C1F3,SDS1,C2F1,C2F2,SDS2,STD)
WAEHRUNG:                EUR          (EUR)



-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B793058R -- 13/04/15 -- 16:50:10 --
AE0700F  Feld muss einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF1:Hilfe  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

6.1.3.5.2 (B) Mögliche Funktionscodes für den Cash Forecast:

Die Informationen können anhand folgender Kriterien selektiert werden:

CF: Hier können alle notwendigen Geldinformationen – insbesondere der aktuelle Dispositionsbetrag – zusammengefasst für das Geldverrechnungskonto abgerufen werden. Darin enthalten sind die Abwicklungsdaten für alle CBF-Konten, die mit dem Geldverrechnungskonto verknüpft sind.

RI: Hier können Informationen über die aktuelle Konfigurationsregel abgefragt werden. Die hier angezeigte Maske ist weitgehend identisch zur Erfassungsmaske der Cash Forecast Konfiguration.

DE: Hier können die Cash Forecast Daten für einzelne CBF-Konten über alle Geschäftsbereiche (Abwicklung, Kapitaldienste, Inkasso, ausländische Märkte) hinweg sowie der, pro Bereich, ermittelte jeweilige Gesamtsaldo abgerufen werden.

6.1.3.5.3 (C) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
BANK/GELDKONTO-NR	Hier ist entweder ein Geldverrechnungskonto (Unterkonto xxxx-220) in Verbindung mit dem Funktionscode „CF" – Übersicht für Geldverrechnungskonto – oder eine vierstellige CBF-Kontonummer in Verbindung mit dem Funktionscode „DE" – Übersicht für CBF-Kontostamm – einzugeben. Die CBF-Kontonummer wird in der Regel automatisch anhand der User-ID ermittelt.
TAG DER GELDVERRECHNUNG	Ist mit dem aktuellen Valutatag vorbelegt. Bei Abfrage des Cash Forecast für die STD-Verarbeitung wird automatisch der folgende Valutatag angezeigt. Die Abfrage von in der Zukunft liegenden Cash Forecast-Daten über die STD-Verarbeitung für den folgenden Geschäftstag hinaus ist nicht möglich. Die Abfrage von historischen Daten ist für alle Verarbeitungsläufe 132 Arbeitstage rückwirkend möglich.
VERARBEITUNGSLAUF	Ist automatisch mit dem nächstfolgenden Verarbeitungslauf vorbelegt und kann überschrieben werden (siehe Kürzel auf der Hilfe-Maske). Bitte beachten Sie, dass der Wert „NTS" derzeit nicht als Selektionskriterium unterstützt wird. Daher wird nach der Eingabe von „NTS" eine Fehlermeldung angezeigt. Diese gibt den Hinweis, dass Daten erst nach der Migration auf T2S angezeigt werden können.
WAEHRUNG	Bislang ist „EUR" die einzig gültige Eingabe für dieses Pflichtfeld.

6.1.3.5.4 (D) Hilfemaske

Im Auswahlmenü gelangt der Anwender durch betätigen der Taste F1 auf eine Hilfe-Maske. Neben den Eingabemöglichkeiten für Detailanzeigen, sind in dieser Maske die einzelnen Verarbeitungsläufe, sowie die zugehörigen Fristen in denen ein Reservierungsauftrag erteilt werden kann, aufgelistet.

```
TRAN: KUCF FC: CF SB: 7930#220#EUR#24.08.2011#STD

 EINGABEMOEGLICHKEITEN FUER VERARBEITUNGSLAUF
 TAGESVERARBEITUNG:
 C1F1      1.ZYKLUS VOR 1.SDS     7:10 -  8:00
 C1F2      2.ZYKLUS VOR 1.SDS     8:00 -  9:00
 C1F3      3.ZYKLUS VOR 1.SDS     9:00 - 10:00
 SDS1      ZYKLUS 1.SDS          10:00 - 10:45

 C2F1      1.ZYKLUS VOR 2.SDS    10:45 - 12:00
 C2F2      2.ZYKLUS VOR 2.SDS    12:00 - 13:15
 SDS2      ZYKLUS 2. SDS         13:15 - 14:00
 C2F1      1.ZYKLUS VOR 2.SDS    10:45 - 12:00
 NACHTVERARBEITUNG:
 STD       ZYKLUS                19:00 -  6:00

 EINGABEMOEGLICHKEITEN FUER DETAILANZEIGEN
 I         UEBERSICHT PRO BANK
 X         UEBERSICHT AUSL. MAERKTE PRO GELDKONTO - NICHT MOEGLICH BEI
           UEBERSICHT AUSL. MAERKTE PRO BANK

-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B79073FX - 23/08/11 -- 12:37:25 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

6.1.3.5.5 (E) Navigation

Nach Aufruf der Übersicht für Geldkonto (KUCF / CF) bzw. für CBF-Kundenstamm (KUCF / DE) besteht die Möglichkeit, durch Eingabe der Kennzeichen „I“ und „X“, diverse, zum Teil verzweigte, Folgemasken zur Auswahl und zur Information aufzurufen. Das folgende Schaubild veranschaulicht die Navigation im Cash Forecast System.

6.1.3.6 Cash Forecast – Übersicht für Geldkonto (KUCF / CF)

6.1.3.6.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Kunden, welche die Geldverrechnung mit CBF über TARGET2 selbst durchführen und daher über ein Geldverrechnungskonto verfügen, können zusätzlich zur Funktion „Übersicht für CBF-Konto“ (KUCF / DE) auch die Funktion „Übersicht für Geldkonto“ (KUCF / CF) nutzen. Optisch unterscheiden sich diese Übersichten nur geringfügig:

```
TRAN: KUCF FC: CF SB: 7930#220#EUR#24.08.2011#STD

CASH FORECAST UEBERSICHT FUER GELDKONTO
GELDKONTO: 7930 220 TESTBANK AG
TAG DER GELDVERRECHNUNG: 24.08.2011 VERARBEITUNGSLAUF: STD
RESERVIERUNGSFRIST:      23.08.2011 19:00 UHR
                                      SOLL IN EUR            HABEN IN EUR
_ ABWICKLUNG                                                266.240.105,33
  SPERREN LT. REGEL                   46.387.417,13
_ KAPITALDIENSTZAHLUNGEN                                      3.260.414,92

---------------------------- ----------------------  ----------------------
_ CASH FORECAST                                             223.113.103,12
  INKASSOPFLICHT (ZAHLSTELLE)                                         0,00
  AUSLAENDISCHE MAERKTE                    45.436,69
---------------------------- ----------------------  ----------------------
_ AKT. DISPOSITIONSBETRAG                          0,00
============================== ZUR INFORMATION ==============================
  AKTUELLER GELDSALDO 7930 220                                        0,00
_ SONSTIGE SPERREN                   255.191.900,47
  SELBSTBESICHERUNG                                         109.809.252,37
-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B793058S -- 23/08/11 -- 15:09:21 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Für diejenigen Kunden, die die Geldverrechnung ausschließlich für sich selbst und eigene Filialen durchführen (Direct Cash Clearer), sind die in dieser Übersicht angezeigten Salden identisch zu jenen aus der Übersicht für das CBF-Konto (KUCF / DE). Für Kunden, welche die Geldverrechnung für sich selbst und für andere Kunden als Korrespondenz- oder Drittbank durchführen (General Cash Clearer), stellt die „Übersicht für Geldkonto“ eine Zusammenfassung über alle für die Gelddisposition relevanten Geldsalden über alle verknüpften Konten dar.

Der ausgewiesene Betrag ist der Richtwert für die Geldliquidität, die bis zur Frist für den nächsten Verarbeitungslauf im TARGET2 System reserviert werden sollte.

6.1.3.6.2 (B) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
GELDKONTO, TAG DER GELDVER-RECHNUNG, VERARBEITUNGSLAUF	Wie im Auswahlmenü selektiert.
RESERVIERUNGSFRIST	Zeigt das Datum und die Uhrzeit an, bis wann der Reservierungsauftrag für den selektierten Verarbeitungslauf eingestellt werden kann.
ABWICKLUNG	Summe der Gegenwerte aller Transaktionen, außer Käufe mit Kontrahenten in Frankreich, Niederlande oder Belgien (ESES-Märkte), die gemäß Cash Forecast-Konfiguration in den Dispositionsbetrag einfließen und für den selektierten Verarbeitungslauf zur Abwicklung anstehen. Ist hier ein Saldo ausgewiesen, so kann durch Eingabe des Kennzeichens „I", gefolgt von der Freigabetaste, die zugehörige Listenansicht „Anteil Abwicklung pro Bank" angezeigt werden.
SPERREN LAUT REGEL	Summe der Gegenwerte aller gesperrten Transaktionen, die laut Cash Forecast-Konfiguration in den Dispositionsbetrag einfließen. Ist hier ein Saldo ausgewiesen, so kann durch Eingabe des Kennzeichens „I", gefolgt von der Freigabetaste, die zugehörige Listenansicht „Anteil Sperren lt. Regel pro Bank" angezeigt werden.
KAPITALDIENST-ZAHLUNGEN	Summe aller Kapitaldienstzahlungen aus Wertpapieren des Bundes, die im Rahmen der CBF-Nachtverarbeitung verrechnet werden. Diese Zahlungen werden nur für die STD-Verarbeitung auf Basis der Wertpapierbestände in den betroffenen Gattungen nach der vorangegangenen STD-Massenverarbeitung errechnet. Eventuelle Bestandsveränderungen aus den folgenden Verarbeitungszyklen werden in dieser Zahl nicht mehr berücksichtigt. Ist hier ein Saldo ausgewiesen, so kann durch Eingabe des Kennzeichens „I", gefolgt von der Freigabetaste, die zugehörige Listenansicht „Anteil Kapitaldienstzahlungen pro Bank" angezeigt werden.
CASH FORECAST	Summe aus allen oben aufgeführten Beträgen, d. h. aus Abwicklung, Sperren laut Regel und Kapitaldienstzahlungen. Ist hier ein Saldo ausgewiesen, so kann durch Eingabe des Kennzeichens „I", gefolgt von der Freigabetaste, die zugehörige Listenansicht „Anteil Cash Forecast pro Bank" angezeigt werden.
INKASSOPFLICHT (ZAHLSTELLE)	Dieses Feld ist derzeit nur für die Zahlstelle des Bundes relevant, da alle anderen Inkassozahlungen bis auf weiteres erst in die Geldverrechnung nach der SDS1-Verarbeitung einfließen.

AUSLAENDISCHE MAERKTE	Dispositionsbetrag für Käufe auf Bruttobasis aus Geschäften mit Kontrahenten in den ESES Märkten. Der ausgewiesene Betrag kann nicht mit Erträgen aus Verkäufen aus dem deutschen Markt verrechnet werden. Ist hier ein Saldo ausgewiesen, so führt die Eingabe des Kennzeichens „X", gefolgt von der Freigabetaste, auf die Seite „Anteil ausländische Märkte per Geldkonto", in der die einzelnen, nach Märkten aufgegliederten, Dispositionsbeträge angezeigt werden. Diese Dispositionsbeträge dienen als Grundlage für die Zuteilung reservierter Liquidität auf die Marktzuweisungskonten bei Anwendung der „Pro-Rata-Option" in der Marktregel bei Liquiditätsunterdeckung (siehe Abschnitt 6.1.1.5). Währenddessen führt die Eingabe des Kennzeichens „I" zu der zugehörigen Listenansicht „Anteil ausländische Märkte pro Bank".
AKT. DISPOSITIONS-BETRAG	Der aktuelle Dispositionsbetrag entspricht dem Liquiditätsbedarf, der sich aus dem Cash Forecast Betrag für den entsprechenden Verarbeitungslauf ergibt. Ist der Cash Forecast Betrag positiv oder null, besteht rein rechnerisch kein Finanzierungsbedarf und der aktuelle Dispositionsbetrag wird mit „0" angegeben. Ist der Cash Forecast Betrag negativ, entspricht der aktuelle Dispositionsbetrag dem Cash Forecast Betrag, d. h. es wird für den Verarbeitungslauf per Saldo eine Zahlung erwartet, wodurch die Reservierung von Liquidität in dieser Höhe rein rechnerisch notwendig wird. Der Cash Forecast Betrag und der aktuelle Dispositionsbetrag sind nur Voraussagen unter der Bedingung, dass in dem folgenden Zyklus alle der Berechnung zu Grunde liegenden Transaktionen zu 100% abgewickelt werden können. Der tatsächliche Saldo nach Ende des Verarbeitungslaufs kann erheblich abweichen, wenn Geschäfte auf Grund von unzureichenden Wertpapierbeständen oder ungenügender Liquidität entweder auf eigener Seite oder auf Seite des Kontrahenten nicht reguliert werden können. Eingabe des Kennzeichens „I", gefolgt von der Freigabetaste, führt zur Informationsanzeige der Cash Forecast Konfiguration (= KUCF / RI).
AKTUELLER GELDSALDO	Bei Abfragen des Cash Forecast für den folgenden Verarbeitungslauf wird der Geldsaldo angezeigt, der aktuell im laufenden Zyklus noch auf dem Geldverrechnungskonto für die Abwicklung zur Verfügung steht.
SONSTIGE SPERREN	Der Betrag entspricht der Summe der Gegenwerte aus jenen Geschäften, die laut Konfigurationsregel nicht in den aktuellen Dispositionsbetrag einfließen. Der Betrag wird nur zur Information angezeigt. Ist hier ein Saldo ausgewiesen, so kann durch Eingabe des Kennzeichens „I", gefolgt von der Freigabetaste, die zugehörige Listenansicht „Anteil sonstige Sperren pro Bank" angezeigt werden.
SELBSTBESICHERUNG	Werden laut Konfigurationsregel die Selbstbesicherungsgeschäfte (Eröffnungsgeschäfte) nicht in den aktuellen Dispositionsbetrag eingerechnet, werden sie hier zur Information angezeigt. Ist hier ein Saldo ausgewiesen, so kann durch Eingabe des Kennzeichens „I", gefolgt von der Freigabetaste, die zugehörige Listenansicht „Anteil Selbstbesicherung pro Bank" angezeigt werden.

6.1.3.6.3 (C) Listenansichten

Durch Eingabe des Kennzeichens „I“ vor einem der Felder „ABWICKLUNG“, „SPERREN LT. REGEL“, „KAPITALDIENSTZAHLUNGEN“, „CASH FORECAST“, „AUSLAENDISCHE MAERKTE“, „SONSTIGE SPERREN“ oder „SELBSTBESICHERUNG“ und anschließender Datenfreigabe, wird die zugehörige Listenansicht pro Bank aufgerufen. Interessiert man sich beispielsweise für die Details unter Abwicklung, so wird die folgende Maske angezeigt:

```
TRAN: KUCF FC: CF SB: 7930#220#EUR#24.08.2011#STD

CASH FORECAST - ANTEIL ABWICKLUNG PRO BANK                        SEITE   1

GELDKONTO: 7930 220 TESTBANK AG

                  SOLL IN EUR            HABEN IN EUR            SALDO IN EUR
_ 7930         379.387.692,87          712.056.851,87         332.669.159,00
  7931         129.040.802,12           62.611.748,45          66.429.053,67-









     ----------------------  ----------------------  ----------------------
  CASH FORECAST ABWICKLUNG                                    266.240.105,33
                                                             ======================
-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B793058S -- 23/08/11 -- 15:10:19 --
AE0100I  Keine weiteren Daten vorhanden
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Angezeigte Informationen:

Die Listenansicht zeigt tabellarisch die einzelnen Salden der verknüpften CBF-Konten, welche aufsummiert den Gesamtsaldo ergeben. Solche Konten, die keinen Saldo aufweisen, sind in der Liste, aus Gründen der besseren Lesbarkeit, nicht aufgeführt.

Eingebbares Kennzeichen:

ABWICKLUNG	Durch Eingabe des Kennzeichens „I“ vor einer der angezeigten Kontonummern und anschließender Freigabetaste, wird die zugehörige Detailansicht aufgerufen. Diese Detailansicht ist dieselbe, die über die Funktion „Übersicht für CBF-Konto“ (KUCF / DE) (siehe oben) von den einzelnen Kontoinhabern aufgerufen werden kann. Dies ist jedoch nur möglich, wenn die ersten 4 Stellen der User ID dem selektierten CBF-Konto entsprechen.
SPERREN LT. REGEL	Wie Abwicklung.
KAPITALDIENST-ZAHLUNGEN	Kein eingebbares Kennzeichen.
CASH FORECAST	Durch Eingabe des Kennzeichens „I“ vor einer der angezeigten Kontonummern und anschließender Freigabetaste, wird die zugehörige Cash Forecast Übersicht für CBF-Kontostamm aufgerufen. Diese Übersicht ist dieselbe, die über die Funktion „Übersicht für CBF-Konto“ (KUCF / DE) (siehe Abschnitt (F)) von den einzelnen Kontoinhabern aufgerufen werden kann. Dies ist jedoch nur möglich, wenn die ersten 4 Stellen der User ID dem selektierten CBF-Konto entsprechen.
AUSLAENDISCHE MAERKTE	Wie Abwicklung.
SONSTIGE SPERREN	Wie Abwicklung.
SELBSTBESICHERUNG	Kein eingebbares Kennzeichen.

6.1.3.6.4 (D) Listenansicht – Anteil ausländische Märkte per Geldkonto

Durch Eingabe des Kennzeichens „X“ vor dem Feld „AUSLAENDISCHE MAERKTE“ und anschließender Datenfreigabe, wird die zugehörige Listenansicht per Geldkonto aufgerufen:

```
TRAN: KUCF FC: CF SB: 7930#220#EUR#24.08.2011#STD

CASH FORECAST - ANTEIL AUSLAENDISCHE MAERKTE PER GELDKONTO            SEITE   1

GELDKONTO: 7930 TESTBANK AG

                  SOLL IN EUR             HABEN IN EUR             SALDO IN EUR
  7205          2.117.940,18               526.879,95            1.591.060,23-
  7214          4.095.879,52             5.285.375,21            1.189.495,69
  7223                                     356.127,85              356.127,85









     ----------------------  ----------------------  ----------------------
  CASH FORECAST AUSLAENDISCHE MAERKTE                                45.436,69-
                                                                  ==========
-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B79303FX -- 23/08/11 -- 10:39:57 --
AE0100I  Keine weiteren Daten vorhanden
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Angezeigte Informationen:

In der Listenansicht sind die Anteile der Geschäfte in den einzelnen ESES-Märkten auf Geldkontoebene tabellarisch dargestellt, wobei die einzelnen ESES-Märkte durch die zugehörige CBF-Kontonummer repräsentiert werden. Diese können wie folgt zugeordnet werden:

7205 CBF W/EUROCLEAR FRANCE

7214 CFB W/EUROCLEAR NEDERLAND

7223 CBD W/EUROCLEAR BELGIUM

6.1.3.7 Cash Forecast – Übersicht für CBF-Kontostamm (KUCF / DE)

6.1.3.7.1 (A) Allgemeine Beschreibung

CBF-Kontoinhaber, die kein eigenes Geldverrechnungskonto unterhalten (Non Cash Clearer), können ihre Cash Forecast Daten ausschließlich über die Funktion „Übersicht für CBF-Konto“ (KUCF / DE) abrufen.

```
TRAN: KUCF FC: DE SB: 7931##EUR#24.08.2011#STD

CASH FORECAST UEBERSICHT FUER CBF-KONTOSTAMM
BANK:      7931     HANDELSBANK AG
TAG DER GELDVERRECHNUNG: 24.08.2011 VERARBEITUNGSLAUF: STD
RESERVIERUNGSFRIST:      23.08.2011 19:00 UHR
                                      SOLL IN EUR            HABEN IN EUR
  ABWICKLUNG                        66.429.053,67
_ SPERREN LT. REGEL                 36.749.402,30
  KAPITALDIENSTZAHLUNGEN                                     3.260.414,92

----------------------------- ----------------------  ----------------------
  CASH FORECAST                     99.918.041,05
  INKASSOPFLICHT (ZAHLSTELLE)                                            0,00
_ AUSLAENDISCHE MAERKTE              1.804.700,18
----------------------------- ----------------------  ----------------------
  AKT. DISPOSITIONSBETRAG           101.722.741,20
============================== ZUR INFORMATION ==============================

  SONSTIGE SPERREN                  7.856.131,26
  SELBSTBESICHERUNG                                  109.809.252,37
-- ID-KZ: 7931000132 -- PW:          ------ B793058S -- 23/08/11 -- 15:12:09 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Angezeigte Informationen:

Die Übersicht beinhaltet zusammengefasst alle für die Gelddisposition relevanten Geldsalden (Soll oder Haben), aufgeteilt nach den jeweiligen Geschäftsbereichen. Aus diesen Einzelsalden ermittelt sich der jeweils aktuelle Dispositionsbetrag. Dieser Betrag ist der Richtwert für die Geldliquidität, die bis zur Deadline für den nächsten Verarbeitungslauf reserviert werden sollte.

6.1.3.7.2 (B) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
BANK, TAG DER GELDVERRECHNUNG, VERARBEITUNGSLAUF	Wie im Auswahlmenü selektiert.
RESERVIERUNGSFRIST	Zeigt das Datum und die Uhrzeit an, bis wann der Reservierungsauftrag für den selektierten Verarbeitungslauf eingestellt werden kann.
ABWICKLUNG	Summe der Gegenwerte aller Transaktionen, außer Käufe mit Kontrahenten in Frankreich, Niederlande oder Belgien (ESES-Märkte), die gemäß Cash Forecast-Konfiguration in den Dispositionsbetrag einfließen und für den selektierten Verarbeitungslauf zur Abwicklung anstehen. Ist hier ein Saldo ausgewiesen, so kann durch Eingabe des Kennzeichens „I", gefolgt von der Freigabetaste, die zugehörige Detailansicht angezeigt werden.
SPERREN LAUT REGEL	Summe der Gegenwerte aller gesperrten Transaktionen, die laut Cash Forecast-Konfiguration in den Dispositionsbetrag einfließen. Ist hier ein Saldo ausgewiesen, so kann durch Eingabe des Kennzeichens „I", gefolgt von der Freigabetaste, die zugehörige Detailansicht angezeigt werden.
KAPITALDIENST-ZAHLUNGEN	Summe aller Kapitaldienstzahlungen aus Wertpapieren des Bundes, die im Rahmen der CBF-Nachtverarbeitung verrechnet werden. Diese Zahlungen werden nur für die STD-Verarbeitung auf Basis der Wertpapierbestände in den betroffenen Gattungen nach der vorangegangenen STD-Massenverarbeitung errechnet. Eventuelle Bestandsveränderungen aus den folgenden Verarbeitungszyklen werden in dieser Zahl nicht mehr berücksichtigt.
CASH FORECAST	Summe aus allen oben aufgeführten Beträgen, dies bedeutet. aus Abwicklung, Sperren laut Regel und Kapitaldienstzahlungen.
INKASSOPFLICHT (ZAHLSTELLE)	Dieses Feld ist derzeit nur für die Zahlstelle des Bundes relevant, da alle anderen Inkassozahlungen, bis auf weiteres, in die Geldverrechnung nach der SDS1-Verarbeitung einfließen.
AUSLAENDISCHE MAERKTE	Dispositionsbetrag für Käufe auf Bruttobasis aus Geschäften mit Kontrahenten in den ESES Märkten. Der ausgewiesene Betrag kann nicht mit Erträgen aus Verkäufen aus dem deutschen Markt verrechnet werden. Ist hier ein Saldo ausgewiesen, so kann durch Eingabe des Kennzeichens „I", gefolgt von der Freigabetaste, eine Listenansicht aufgerufen werden, in der die einzelnen, nach Märkten aufgegliederten, Beträge angezeigt werden. Obiges Prozedere führt von dieser Ansicht, auf die Detailansicht für den ausgewählten Markt.

AKT. DISPOSITIONS-BETRAG	Der aktuelle Dispositionsbetrag entspricht dem Liquiditätsbedarf, der sich aus dem Cash Forecast Betrag für den entsprechenden Verarbeitungslauf ergibt. Ist der Cash Forecast Betrag positiv oder null, besteht rein rechnerisch kein Finanzierungsbedarf und der aktuelle Dispositionsbetrag wird mit „0“ angegeben. Ist der Cash Forecast Betrag negativ, entspricht der aktuelle Dispositionsbetrag dem Cash Forecast Betrag, d. h. es wird für den Verarbeitungslauf per Saldo eine Zahlung erwartet, wodurch die Reservierung von Liquidität in dieser Höhe rein rechnerisch notwendig wird. Der Cash Forecast Betrag und der aktuelle Dispositionsbetrag sind nur Voraussagen unter der Bedingung, dass in dem folgenden Zyklus alle der Berechnung zu Grunde liegenden Transaktionen zu 100% abgewickelt werden können. Der tatsächliche Saldo nach Ende des Verarbeitungslaufs kann erheblich abweichen, wenn Geschäfte auf Grund von unzureichenden Wertpapierbeständen oder ungenügender Liquidität entweder auf eigener Seite oder auf Seite des Kontrahenten nicht reguliert werden können. Eingabe des Kennzeichens „I", gefolgt von der Freigabetaste, führt zur Informationsanzeige der Cash Forecast Konfiguration (= KUCF / RI).
AKTUELLER GELDSALDO	Bei Abfragen des Cash Forecast für den folgenden Verarbeitungslauf wird der Geldsaldo angezeigt, der aktuell im laufenden Zyklus noch auf dem Geldverrechnungskonto für die Abwicklung zur Verfügung steht.
SONSTIGE SPERREN	Der Betrag entspricht der Summe der Gegenwerte aus jenen Geschäften, die laut Konfigurationsregel nicht in den aktuellen Dispositionsbetrag einfließen und wird nur zur Information angezeigt. Ist hier ein Saldo ausgewiesen, so kann durch Eingabe des Kennzeichens „I", gefolgt von der Freigabetaste, die zugehörige Detailansicht angezeigt werden.
SELBSTBESICHERUNG	Werden laut Konfigurationsregel die Selbstbesicherungsgeschäfte (Eröffnungsgeschäfte) nicht in den aktuellen Dispositionsbetrag eingerechnet, werden sie hier zur Information angezeigt.

6.1.3.7.3 (C) Detailansicht – Abwicklung

Durch Eingabe des Kennzeichens „I“ vor dem Feld „ABWICKLUNG“ wird die zugehörige Detailansicht aufgerufen:

```
TRAN: KUCF FC: DE SB: 7931##EUR#24.08.2011#STD

DETAIL CASH FORECAST ABWICKLUNG

BANK: 7931 HANDELSBANK AG

URSPRUNG                  SOLL IN EUR        HABEN IN EUR        SALDO IN EUR
                    ------------------- ------------------- --------------------
CCP (XETRA/FWB)
BOERSE (NON CCP)              522.416           1.396.017             873.601
CASCADE(OTC/FICCP)        128.518.386          61.215.731          67.302.655-
                    ------------------- ------------------- --------------------
SUMME ABWICKLUNG          129.040.802          62.611.748          66.429.054-
================================================================================

DARIN ENTHALTEN:
NEUEMISSIONEN                                    990.300             990.300




-- ID-KZ: 7931000132 -- PW:          ------ B793058S -- 23/08/11 -- 15:34:34 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Angezeigte Informationen:

In der Folgemaske werden die Abwicklungssalden für das CBF-Konto auf die einzelnen folgenden Geschäftsbereiche heruntergebrochen und daraus jeweils Untersummen gebildet:

- CCP (XETRA/FWB)
- BOERSE (NON CCP)
- CASCADE (OTC/FICCP)

Im Feld NEUEMISSIONEN werden die Geldsalden zur Information angezeigt, die sich aus Geschäften mit Neuemissionen errechnen. Dabei werden alle Wertpapiere berücksichtigt, bei denen der Emissionstag dem jeweiligen Settlementtag entspricht. Die Salden für Neuemissionen sind in der Regel in den unter CASCADE (OTC/FICCP) ausgewiesenen Salden enthalten.

6.1.3.7.4 (D) Detailansicht - Sperren

Durch Eingabe des Kennzeichens „I“ vor dem Feld „SPERREN LT. REGEL“ oder vor dem Feld „SONSTIGE SPERREN“ gelangt man auf die jeweilige Detailansicht. Hier werden die Salden aus solchen Geschäften spezifiziert, die auf Grund von Sperren nicht in den Dispositionssaldo eingerechnet wurden. Basis für die Berechnung der Anzeige ist die Konfigurationsregel. Diese Ansichten unterscheiden sich optisch nur geringfügig.

```
TRAN: KUCF FC: DE SB: 7931##EUR#24.08.2011#STD

DETAIL CASH FORECAST SONSTIGE SPERREN

BANK: 7931 HANDELSBANK AG

URSPRUNG                    SOLL IN EUR        HABEN IN EUR        SALDO IN EUR
                    ------------------- ------------------- --------------------
CCP (XETRA/FWB)
BOERSE (NON CCP)              924.011             290.841             633.171-
CASCADE(OTC/FICCP)          8.816.841           1.593.881           7.222.961-
                    ------------------- ------------------- --------------------
SONSTIGE SPERREN            9.740.852           1.884.722           7.856.130-
================================================================================

DIE ANGABEN UNTER SONSTIGE SPERREN GEHEN NICHT IN DIE BERECHNUNG
DES CASH FORECAST EIN. SIE DIENEN LEDIGLICH IHRER INFORMATION.




-- ID-KZ: 7931000132 -- PW:          ------ B793058S -- 23/08/11 -- 15:39:48 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4: Abbruch
```

Angezeigte Informationen:

Analog der Detailanzeige für die Abwicklungsbeträge wird der Gesamtsaldo unter „sonstige Sperren“ in die folgenden Geschäftsbereiche aufgegliedert:

- CCP (XETRA/FWB)
- BOERSE (NON CCP)
- CASCADE (OTC/FICCP)

Hinweis:

Die Bildschirmanzeige „CASH FORECAST SPERREN LT. REGEL“ gibt Aufschluss über sämtliche gesperrte Geschäfte, die in die Berechnung des CASH FORECAST eingehen, während die Bildschirmanzeige „CASH FORECAST SONSTIGE SPERREN“ die Zusammensetzung derjenigen gesperrten Geschäfte widerspiegelt, die nicht in die Berechnung eingehen.

D. h. der Gesamtsaldo von „Sonstige Sperren“ geht nicht in die Berechnung des aktuellen Dispositionsbetrags ein.

6.1.3.7.5 (E) Detailansicht – Ausländische Märkte

Durch Eingabe des Kennzeichens „I“ vor dem Feld „AUSLAENDISCHE MAERKTE“, mit anschließender Datenfreigabe, wird zunächst eine Listenansicht aufgerufen, in der die Anteile der Geschäfte in den einzelnen ESES-Märkten tabellarisch dargestellt sind.

```
TRAN: KUCF FC: DE SB: 7931##EUR#24.08.2011#STD

CASH FORECAST - ANTEIL AUSLAENDISCHE MAERKTE                        SEITE   1

BANK: 7931 HANDELSBANK AG

                  SOLL IN EUR            HABEN IN EUR            SALDO IN EUR
_ 7205          1.051.862,21              149.589,07             902.273,14-
_ 7214          1.258.554,53                                   1.258.554,53-
  7223                                    356.127,85             356.127,85

     ----------------------  ----------------------  ----------------------
  CASH FORECAST AUSLAENDISCHE MAERKTE                          1.804.700,18-
                                                              ======================
-- ID-KZ: 7931000132 -- PW:          ------ B79313FX -- 23/08/11 -- 10:39:57 --
AE0100I  Keine weiteren Daten vorhanden
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

In dieser Übersicht werden die einzelnen ESES-Märkte durch die zugehörige CBF-Kontonummer repräsentiert. Diese können wie folgt zugeordnet werden:

7205 CBF W/EUROCLEAR FRANCE

7214 CFB W/EUROCLEAR NEDERLAND

7223 CBD W/EUROCLEAR BELGIUM

Geldregulierung in Euro

Durch Eingabe des Kennzeichens „I“, vor einer der angezeigten Kontonummern, und anschließender Datenfreigabe wird die zugehörige Detailansicht aufgerufen:

```
TRAN: KUCF FC: DE SB: 7931##EUR#24.08.2011#STD

DETAIL CASH FORECAST CBF W/EUROCLEAR FRANCE

BANK: 7931 HANDELSBANK AG

URSPRUNG                    SOLL IN EUR        HABEN IN EUR        SALDO IN EUR
                    ------------------- ------------------- --------------------

OTC (NEU)                     1.051.862             149.589             902.273-

                    ------------------- ------------------- --------------------
SUMME                         1.051.862             149.589             902.273-


================================ ZUR INFORMATION ================================
OTC (NEU)
OTC (SCHWEBEND)
OTC (BLOCKIERT)


-- ID-KZ: 7931000132 -- PW:          ------ B79313FX -- 23/08/11 -- 10:42:12 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

6.1.3.8 Cash Information (CI)

6.1.3.8.1 (A) Allgemeine Beschreibung

In den Cash Informationen sind folgende Angaben enthalten:

Funktionscode KI – Kontoinformation:

Darin sind alle Geldbuchungen enthalten, die auf einem Geldverrechnungskonto oder Fundingkonto vorgenommen wurden.

Funktionscode GU – Geldumsatzanzeige:

Hiermit können die Ergebnisse aus allen Verarbeitungsläufen pro CBF-Konto aufgerufen werden.

Ausgehend von dem Hauptauswahlmenü der CBF-Dienste (siehe hierzu Band 1, Abschnitt 0) gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes „CI" zum Auswahlmenü Cash Information:

```
TRAN: KUCI FC:    SB: ##EUR#25.03.2010#STD

CASH INFORMATIONEN

KI   KONTOINFORMATION          (GELDKONTO)
GU   GELDUMSATZANZEIGE         (BANK)









BANK/GELDKONTO-NR:          ____ ___
TAG DER GELDVERRECHNUNG: 25.03.2010   (TT.MM.JJJJ)
VERARBEITUNGSLAUF:       STD          (STD, C1F1, C1F2, C1F3, SDS1,
                                       C2F1, C2F2, SDS2)
WAEHRUNG:                EUR          (EUR)

DIE ANGABE DES VERARBEITUNGSLAUFS BEWIRKT DIE ANZEIGE DIESES UND DER
NACHFOLGENDEN LAEUFE
-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B793058S -- 25/03/10 -- 15:41:09 --
AE0700F  Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF1:Hilfe  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

6.1.3.8.2 (C) Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
GELDKONTO	Geldverrechnungskontonummer bzw. die CBF-Kontonummer, zieht sich automatisch aus den ersten vier Stellen der User ID. Bei dem Funktionscode KI kann die Unterkontonummer des Geldverrechnungskontos mit der eines Fundingkontos überschrieben werden.
TAG DER GELDVERRECHNUNG	Ist mit dem aktuellen Valutatag vorbelegt. Bei Abfrage von historischen Buchungen kann das Datum überschrieben werden. Die Abfrage von historischen Daten ist für alle Verarbeitungsläufe 132 Arbeitstage rückwirkend möglich.
VERARBEITUNGSLAUF	Ist automatisch mit STD vorbelegt. Die Abfrage enthält dann alle Buchungen für einen Valutatag ab der STD-Verarbeitung. Wird das Feld mit einem anderen Wert überschrieben, werden alle Buchungen ab diesem Verarbeitungslauf angezeigt.
WÄHRUNG	Ist vorbelegt mit EUR und kann nicht überschrieben werden

6.1.3.8.3 (D) Ausgabemaske Kontoinformation (KI)

```
TRAN: KUCI FC: KI SB: 7930#220#EUR#25.03.2010#SDS2

GELDKONTO : 7930 220 TESTBANK AG

KONTOINFORMATION        VOM 25.03.2010                    NR.  13    SEITE   1

  KONTO-NR                                  SOLL IN EUR             HABEN IN EUR
  7930 220 ALTER SALDO PER 23.08.2011                                        0,00
  ------------------------------------------------------------------------------
                         TXT LAUF
_ 7930     KADI/SETTLEM. 800 SDS2                                    1.877.759,74
  7931     KADI/SETTLEM. 800 SDS2                                   68.506.169,07
_          AUSZAHLUNG    103 SDS2          70.383.928,81




  ------------------------------------------------------------------------------
  7930 220 NEUER SALDO PER 25.03.2010                                        0,00
  ==============================================================================
-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B793058S -- 25/03/10 -- 15:43:33 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Feldbesonderheiten

	Feldinhalt
GELDKONTO	Geldkonto, auf dem die Buchung erfolgte
KONTOINFORMATION VOM	Datum des Tages der Geldverrechnung
NR.	Laufende Nummer der Kontoinformation. Die Nummerierung ist fortlaufend beginnend mit dem ersten Arbeitstag eines Jahres. Die Nummer wird täglich hochgezählt, sofern das Geldkonto Umsätze aufweist. An Tagen ohne Umsätze wird keine Nummer vergeben. Hinweis: Werden ausschließlich Reservierungen und Rücknahme Reservierungen in gleicher Höhe gebucht, ohne das tatsächliche Ergebnisse aus en Verarbeitungsläufen eingezogen oder ausgezahlt werden, wird ebenfalls keine Nummer vergeben.
ALTER SALDO PER	Anfangssaldo zu Beginn des Tages. Ist immer 0.
KONTO-NR	Bei KADI/SETTLM. Buchung: CBF-Konto für das der Saldo ermittelt wurde Bei UEBERTRAG Buchung: Geldkonto-Nr. gegen die ein Transfer von reservierter Liquidität vom Fundingkonto auf das Geldverrechnungskonto oder umgekehrt gebucht wurde.

Ohne Titel	Folgende Buchungen werden angezeigt: • RESERVIERUNG: Gutschrift des bestätigten Reservierungsbetrags • RESERV.RUECK: Rückbuchung der ursprünglichen Reservierung • KADI/SETTLEM.: Saldo aus dem Verarbeitungslauf für das entsprechende CBF-Konto • ÜBERTRAG: Transfer von reservierter Liquidität vom Fundingkonto auf das Geldverrechnungskonto oder umgekehrt
TXT	Buchungstextschlüssel Geld (die komplette Auflistung findet sich in Kapitel 23, Tabellen)
LAUF	Verarbeitungslauf, für den die Buchung erfolgte
SOLL IN EUR	Betrag, der belastet wird
HABEN IN EUR	Betrag, der gutgeschrieben wird
NEUER SALDO	Saldo, der zur Zeit des Abrufs auf dem Geldkonto gutgeschrieben ist. Ist nach Ende eines Verarbeitungslaufs immer 0.

Eingebbares Kennzeichen:

Bei RESERVIERUNG, RESERV.RUECK. und UEBERTRAG:

Durch die Eingabe von „I" und Drücken der Enter-Taste wird der Geldauftrag im Detail angezeigt. Die Anzeige entspricht der aus der Abfrage über die Transaktion KNGI-IG.

Bei KADI/SETTLEM:

Durch Eingabe von „I" und Drücken der Enter-Taste verzweigt man in die Geldumsatzanzeige (siehe KUCI-GU)

6.1.3.8.4 (E) Ausgabemaske Geldumsatzanzeige

```
TRAN: KUCI FC: GU SB: 7930##EUR#25.03.2010#STD

BANK: 7930 TESTBANK AG

G E L D U M S A T Z A N Z E I G E  VOM 25.03.2010                    SEITE   1

                  TXT LAUF VALUTA            SOLL IN EUR           HABEN IN EUR
-------------------------------------------------------------------------------
SETTLEMENT        201 STD  25.03.         112.168.886,07
SETTLEMENT        201 C1F1 25.03.                                    471.484,67
SETTLEMENT        201 C1F2 25.03.                                     14.714,89
SETTLEMENT        201 C1F3 25.03.                                  8.170.479,12
SETTLEMENT        201 SDS1 25.03.                                 12.448.132,16
SETTLEMENT        201 C2F1 25.03.                                  8.236.577,39
SETTLEMENT        201 C2F2 25.03.             150.812,67
SETTLEMENT        201 SDS2 25.03.                                  1.877.759,74


-------------------------------------------------------------------------------
TOTAL                                      81.100.550,77
===============================================================================
-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B793058S -- 25/03/10 -- 15:45:00 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Feldbesonderheiten:

1. Spalte (Ohne Titel)	Folgende Buchungen werden angezeigt: • SETTLEMENT: Saldo aus der Wertpapierabwicklung • ZINSEN: Zinszahlungen des Bundes • ZINSEN NACHL: Zinszahlungen des Bundes, nachträglich abgerechnet • GESAMT RUECKZAHL: Rückzahlungen des Bundes
TXT	Buchungstextschlüssel Geld (die komplette Auflistung findet sich in Kapitel 23, Tabellen)
LAUF	Verarbeitungslauf, für den die Buchung erfolgte
VALUTA	Tag der Geldverrechnung
SOLL IN EUR	Betrag, der belastet wird
GESAMT	Verrechneter Geldsaldo in EUR

Hinweis: Die Geldumsätze sind 132 Arbeitstage rückwirkend abrufbar.

6.2 Information Kapitaldienste und sonstige Geldumsätze

(A) Allgemeine Beschreibung

Alle Geldumsätze, die nicht direkt aus der DvP-Abwicklung von Wertpapiertransaktionen resultieren, werden in den DD1-, DD2- und DD3-Geldverrechnungszyklen (Direct Debit) verrechnet. Hierbei handelt es sich hauptsächlich um Zahlungen aus Kapitaldiensten (Erträgnisse, Rückzahlungen), Kursdifferenzen, Gebühren etc.

Die Verrechnung dieser Zahlungen erfolgt direkt mit den TARGET2-Hauptkonten gemäß der TARGET2-Prozedur 3 in folgenden Geldverrechnungszyklen:

- DD1 – Geldverrechnungszyklen vor SDS1 (ca. 09:30 Uhr)
- DD2 – Geldverrechnungszyklen nach SDS2 (ca. 13:45 Uhr)
- DD3 – Geldverrechnungszyklen nur für manuell generierte Zahlungen (ca. 15:15 Uhr)

Innerhalb dieser Geldverrechnungszyklen können jeweils bis zu neun Beträge, so genannte Pakete mit TARGET2 verrechnet werden.

Ausgenommen von der Geldverrechnung innerhalb der DD-Zyklen sind die Kapitaldienstzahlungen des Bundes, die analog zu der Geldverrechnung für die Wertpapierabwicklung gemäß der TARGET2 Prozedur 6 (Verbuchung auf Unterkonto 220) mit den Abwicklungsergebnissen aus der Nachtverarbeitung verrechnet und über die RTGS-Unterkonten der Kunden ausgeschüttet werden. Die Zahlung erfolgt innerhalb der STD - Geldverrechnung aus der Nachtverarbeitung (ca. 06:00 Uhr).

Über den Transaktionscode KNZI können Informationen zu diesen Zahlungen und deren Verrechnung mit TARGET2 abgerufen werden. Vom Hauptmenu „Auftragsabwicklung Geld" aus kann die entsprechende Auswahlmaske über den Transaktionscode „ZI" aufgerufen werden.

Historische Daten stehen im online Abruf bis zu zwei Jahre rückwirkend zur Verfügung. Pro Abfrage können jeweils nur Zahlungen für einen Zeitraum von vier Wochen aufgerufen werden. Werden Daten für einen größeren Zeitraum benötigt, kann das über mehrere Abfragen von jeweils 4-Wochen-Perioden erreicht werden.

Auswahlmaske – Kapitaldienste und sonstige Geldumsätze Information

Über vier Funktionscodes können Nicht-Settlement-Zahlungen nach verschiedenen Kriterien ausgewählt werden:

IK – KAPITALDIENSTE FÜR STD:
Enthält die Kapitaldienstzahlungen des Bundes, die innerhalb der Nachtverarbeitung verrechnet werden

IN – GENETTETE INSTRUKTIONEN FÜR DD-VERARBEITUNG:
Aufstellung der einzelnen Salden, die innerhalb der DD1-, DD2- und DD3- Verarbeitung mit den RTGS-Konten der Kunden in TARGET2 verrechnet werden

ID – DETAIL INSTRUKTIONENE FÜR DD-VERARBEITUNG:
Enthält eine detaillierte Aufstellung über die einzelnen Zahlungen, die in die Salden fließen, die mit TARGET2 verrechnet werden.

IS – SELECT-KONTEN:
Nur für Teilnehmer am GCPooling Select Service.

```
TRAN: KNZI FC: ID SB: 1234##08.04.2015#

KAPITALDIENSTE UND SONSTIGE GELDUMSÄTZE   I N F O R M A T I O N

IN GENETTETE INSTRUKTIONEN F. DD-VERARBEITUNG   IK KAPITALDIENSTE FÜR STD
ID DETAIL INSTRUKTIONEN F. DD-VERARBEITUNG      IS SELECT-KONTEN


ZUSÄTZLICHE AUSWAHL:
 GELDKONTO              : 1234
 RTGS-KONTO             : ___________     SOLL/HABEN (S/H/ )     : _

 TAG DER GELDVERRECHNUNG: 08.04.2015 ( BIS: 08.04.2015 )
 VERARBEITUNGSLAUF      : ____            PAKET-NR               : __
 BETRAG (EUR)           : _________________
 BUCHUNGSTEXT           :                 LAUF-NR                :
 VALUTA                 : __________      TERMINART              : ___
                                          HAUPTZAHLSTELLE (MPA)  : ____
 STATUS                 :                 ISIN                   :
 URSPRUNG               : ______          INSTRUKTIONS-ID      : _______________

-- ID-KZ: 1234260001 -- PW:          ------ B123458R -- 08/04/15 -- 09:37:04 --
```

PF1:Hilfe PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

Zusätzlich zu den Funktionscodes erlaubt die Eingrenzung der Abfrage über folgende Selektionskriterien die zielgerichtete Suche nach bestimmten Geldbuchungen:

Funktionscode	Feldname	Inhalt
IK, IN, ID, IS	• GELDKONTO	IN: CBF-Kontonummer, vorbelegt mit den ersten 4 Stellen der User ID IK: Geldkontonummer, vorbelegt mit Geldverrechnungskonto, das sich aus der User-ID ergibt ID: CBF-Kontostamm oder CBF-Unterkonto, vorbelegt mit den ersten 4 Stellen der User ID, Unterkonto kann eingefügt werden IS: nur für Teilnehmer des GCPooling Select Services
IN , ID, IS	RTGS-KONTO	11-stelliger BIC des RTGS-Kontos in TARGET2
IK, IN, ID, IS	TAG DER GELDVERRECHNUNG	Voreinstellung mit aktuellem Datum (132 Arbeitstage rückwirkend abrufbar)
IK, IN, ID	VERARBEITUNGSLAUF	IK: nur STD IN, ID: DD1, DD2 oder DD3
IN, ID	PAKET-NR	Angabe des individuellen Pakets, in dem ein Betrag innerhalb des DD1-, DD2- oder DD3-Zyklus verrechnet – wurde: 1 – 9
ID	BETRAG (EUR)	Angabe eines Einzelbetrags, der in der gewählten Geldverrechnung abgewickelt wurde Es können maximal 11 Vorkomma- und 2 Nachkommastellen (11,2) eingegeben werden. Wenn kein Komma oder keine Nachkommastellen eingegeben werden, wird das Feld automatisch mit „,00“ aufgefüllt. Trennzeichen werden automatisch eingesetzt.
ID	BUCHUNGSTEXT	3-stelliger numerischer Buchungstextschlüssel Geld (die komplette Auflistung findet sich in Kapitel 23, Tabellen)
ID	LAUF-NR	Verarbeitungsnummer aus KADI (6-stellig)
IK, ID	VALUTA	Valutatag der Zahlung
ID	TERMINART	Terminart, unter der KADI eine Kapitaldienstzahlung verarbeitet hat (gemäß WSIT)
IK, ID	HAUPTZAHLSTELLE (MPA)	CBF-Kontonummer der Hauptzahlstelle (Main Paying Agent)
IK, IN, ID, IS	STATUS	Status der Zahlung: 3-stelliger, numerischer Status Code (s. Hilfe-Bildschirm unten)

ID	ISIN	Durch Eingabe der 12-stelligen ISIN können Zahlungen abgerufen werden, die sich auf Kapitalmaßnahmen in einer bestimmten Gattung beziehen. Hierbei werden nur Zahlungen angezeigt, die von CBF automatisch (über KADI) generiert wurden. Die Suche über die ISIN kann durch die Eingabe zusätzlicher Selektionskriterien weiter eingeschränkt werden.
ID	URSPRUNG	CBF-System, das die Geldbuchung erzeugt hat: CL - Cash Lifecycle CL-MAN - Cash Lifecycle manuell KADI – Kapitaldienstzahlungen KVG - KV-Geld (Prozedur 3 Zahlungen) VAULTS - Tresor

Zur Transaktion KNZI existiert eine HILFE-Maske, in der die Kürzel für die zugelassenen Geldverrechnungszyklen und Statusinformationen aufgelistet sind. Die Maske ist abrufbar mit F1.

(A) Hilfemaske – Kapitaldienste und sonstige Geldumsätze Information

```
TRAN: KNZI FC: IN SB: ##04.04.2013#

KAPITALDIENSTE UND SONSTIGE GELDUMSÄTZE                H I L F E

 LAUF       STARTZEIT     STATUS FÜR ZAHLUNG:

 STD        19:00         099    ABGELEHNT
                          150    GÜLTIG ERTEILT
 DD1         9:30         200    VERARBEITUNG T2I AUSSTEHEND
 DD2        13:45                (NUR BEI DD1/DD2/DD3)
 DD3        15:15         300    VERARBEITUNG SETTLEMENT ENGINE AUSSTEHEND
                                  (NUR BEI STD)
                          350    VERARBEITET

 ABLEHNUNGSGRUND FÜR ZAHLUNG:
 GIF        GELIEFERTE INSTRUKTION FEHLERHAFT
 BST        ABGELEHNT WEGEN GELDBESTAND
 INS        INSTRUKTION FEHLERHAFT VON SSP
 PAK        PAKET FEHLERHAFT


-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B790749U -- 04/04/13 -- 11:51:53 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Geldaufträge (nur Kapitaldienste/Information)

Die Abfrage enthält den Verrechnungsbetrag für Kapitaldienstzahlungen des Bundes, der nach Ende der Nachtverarbeitung zusammen mit den Abwicklungsergebnissen aus STD und RT-STD mit TARGET2 verrechnet wird. Der Abruf erfolgt über das Geldverrechnungskonto (Unterkonto 220).

(A) Tabellarische Anzeige – Geldaufträge (nur Kapitaldienste)/Information

```
TRAN: KNZI FC: IK SB: 7930##01.11.2010#

GELDAUFTRÄGE (NUR KAPITALDIENSTE) / I N F O R M A T I O N
 ANZ. AUFTRÄGE:     0                        1    VALUTA:             SEITE   1
                0,00 S         84.553.269,62 H  SALDO:        84.553.269,62 H

K GELDVERR.  TYP                GELDKONTO       BETRAG IN EUR ZA  VS  AG  MPA
--------------------------------------------------------------------------------
_ 12.11.2010 KADIZAHLUNG        7930 220        84.553.269,62 H  099  A   7931









-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79304E5 -- 30/11/10 -- 15:44:26 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Unterhält ein Kunde unter seiner CBF-Kontostammnummer ein eigenes Geldverrechnungskonto, ist das Feld *Geldkonto* automatisch mit der entsprechenden Kontonummer vorbelegt (meist Unterkontonummer 220). Kunden, die unter ihrer eigenen CBF-Kontostammnummer kein eigenes Geldverrechnungskonto unterhalten, können diese Abfrage nicht nutzen.

Mit der Eingabe von „*i*“ kann in die Detailanzeige verzweigt werden:

(A) Detailanzeige – Geldaufträge Kapitaldienste/Information

```
TRAN: KNZI FC: IK SB: 7930#220#01.03.2010#

GELDAUFTRAG KAPITALDIENSTE / I N F O R M A T I O N




GELDKONTO            : 7930 220 TESTBANK AG

BETRAG               :             9.270,00  EUR  (HABEN)

HAUPTZAHLSTELLE (MPA): 7950  BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND



TAG DER GELDVERRECHNUNG: 12.03.2010  VALUTA: 12.03.2010
STATUS  :  350 VERARBEITET

URSPRUNG:  STD-VERARBEITUNG
VERARBEITUNGSLAUF: STD

-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B793058S -- 25/03/10 -- 15:50:22 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Detaillierte Informationen darüber, wie sich der ausgewiesene Betrag im Einzelnen zusammensetzt, sind weiterhin über die Transaktion KVGI abzurufen.

Genettete Instruktionen für DD-Verarbeitung

Über diese Funktion werden die einzelnen Salden aufgerufen, die mit TARGET2 gemäß der ASI Prozedur 3 verrechnet werden. Die Geldverrechnung aus den DD1-,DD2- und DD3-Zyklen erfolgt nicht notwendigerweise in einem Betrag, sondern in so genannten Paketen, d. h. es können pro DD-Lauf bis zu 9 einzelne Beträge (Pakete) verrechnet werden.

Nutzt ein Kunde die Netting-Funktion, d. h. werden über sein CBF-Konto die Salden für mehrere CBF-Konten akkumuliert in einer Summe über TARGET2 verrechnet, werden die einzelnen Verrechnungsbeträge pro CBF-Konto separat ausgewiesen.

Beträge, die im Haben ausgewiesen sind, entsprechen einer Belastung auf TARGET2-Seite, Soll-Beträge einer Gutschrift.

Diese Anzeige ersetzt die bisherige Geldumsatzanzeige über die CASCADE Transaktion KVUM-GU.

(A) Tabellarische Anzeige – Genettete Instruktionen für DD-Verarbeitung/Information

```
TRAN: KNZI FC: IN SB: 7930##01.11.2010#

GENETTETE INSTRUKTIONEN FÜR DD-VERARBEITUNG  /  I N F O R M A T I O N
 ANZ. AUFTRÄGE:    24                      31                        SEITE   1
       769.336.622,41 S      1.186.936.234,55 H  SALDO:       417.599.612,14 H

K GELDVERR.  LAUF  RTGS-KONTO   KTS   WG. PAKET        BETRAG IN EUR ZA  C  VS
-------------------------------------------------------------------------------
_ 30.11.2010 DD1   DAKVDEF0301 7930           1           136.109,40  H  J 350
_ 30.11.2010 DD1   DAKVDEF0301 7930           9               357,90  S  J 350
  30.11.2010 DD2   DAKVDEF0301 7930           1               358,79  H  J 350









-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79304E5 -- 30/11/10 -- 15:39:01 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Folgende Inhalte werden pro Verrechnungssaldo angezeigt:

	Feldinhalt
GELDDVERR.	Datum der Geldverrechnung
LAUF	DD-Lauf, in dem die Geldverrechnung erfolgt DD1, DD2 oder DD3
RTGS-KONTO	11-Stelliger BIC, über den die Geldverrechnung seitens TARGET2 erfolgt
KTS	CBF-Kontonummer, über die die Geldverrechnung erfolgt
WG.	CBF-Kontonummer, deren Saldo über das abweichende CBF-Konto unter KTS verrechnet wurde
PAKTET	Paketnummer innerhalb eines DD-Laufs, in dem die Geldverrechnung erfolgt 1 - 9
BETRAG IN EUR	Verrechnungsbetrag in EUR
ZA	H – Haben - Gutschrift auf TARGET2-Konto S - Soll – Lastschrift auf TARGET2-Konto
C	Kennzeichen, ob es sich um eine Custody Zahlung handelt: J – Ja – Custody Zahlung N – Nein – Keine Custody Zahlung
VS	Verarbeitungsstatus (siehe KNZI-Hilfemaske oben)

Mit der Eingabe von *i* vor dem entsprechenden Saldo kann in die Detailanzeige verzweigt werden:

(B) Detailanzeige – Genettete Instruktionen für DD-Verarbeitung/Information

```
TRAN: KNZI FC: IN SB: 7930##25.03.2010#

GENETTETE INSTRUKTION FÜR DD-VERARBEITUNG  /  I N F O R M A T I O N

TAG DER GELDVERRECHNUNG  : 25.03.2010
VERARBEITUNGSLAUF        : DD1            PAKET-NR :  9

RTGS-KONTO (SOLL)        : BIC DAKVDEFFAS2
RTGS-KONTO (HABEN)       : BIC HABADEFFXXX
KONTOSTAMM (SOLL)        : 7750 CLEARSTREAM BANKING AG
KONTOSTAMM (HABEN)       : 7930 TESTBANK AG

BETRAG                   :            67.995,29 EUR


CUSTODY                  : J

STATUS           : 350 VERARBEITET

URSPRUNG         : CL

-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B793058S -- 25/03/10 -- 16:09:07 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Detail Instruktionen für DD-Verarbeitung

Diese Abfrage über den Funktionscode ID enthält die Beträge, die in den einzelnen DD1-,DD2 und DD3--Paketen über TARGET2 verrechnet wurden.

Zudem werden die Teilbeträge aus den verschiedenen Geschäftsbereichen aufgelistet, die innerhalb der DD1-,DD2- und DD3-Verarbeitung verrechnet werden. Diese Beträge werden nicht nochmals nach Verrechnungspaket unterteilt, sondern sind für die jeweilige DD- Verrechnung zusammengefasst.

Die Anzeige enthält zudem Informationen zum Status der einzelnen Geldbuchung.

Historische Daten stehen im online Abruf bis zu zwei Jahre rückwirkend zur Verfügung. Pro Abfrage können jeweils nur Zahlungen für einen Zeitraum von vier Wochen aufgerufen werden. Werden Daten für einen größeren Zeitraum benötigt, kann das über mehrere Abfragen von jeweils 4-Wochen-Perioden erreicht werden.

(A) Tabellarische Anzeige – Detailinstruktionen für DD-Verarbeitung/Information

```
TRAN: KNZI FC: ID SB: 7930##01.11.2010#

DETAIL INSTRUKTIONEN FÜR DD-VERARBEITUNG  /  I N F O R M A T I O N
ANZ. AUFTRÄGE:   226                    610    VALUTA:              SEITE   1
    2.378.143.178,03 S      2.378.143.178,03 H  SALDO:                0,00 H

K GELDVERR.   LAUF  TXT  TA    GELDKONTO        BETRAG IN EUR ZA  VS  PNR MPA
-------------------------------------------------------------------------------
_ 30.11.2010  DD1   051         7930 000           136.109,40  S  350   1
  30.11.2010  DD1   052         7930 000               357,90  H  350   9
_ 30.11.2010  DD1   302  110    7930 000               357,90  S  350   9 7931
_ 30.11.2010  DD1   308  110    7930 000                 0,89  S  350   1 7931
  30.11.2010  DD1   400  126    7930 000           136.110,29  H  350   1 7931
_ 30.11.2010  DD2   091         7930 000               358,79  S  350   1
_ 30.11.2010  DD2   304  110    7930 000               357,90  H  350   1 7931
_ 30.11.2010  DD2   310  110    7930 000                 0,89  H  350   1 7931
_ 29.11.2010  DD1   051         7930 000       124.960.619,19  H  350   1
  29.11.2010  DD1   052         7930 000               357,90  H  350   9
_ 29.11.2010  DD1   300  110    7930 000         8.500.000,00  H  350   1 7931
_ 29.11.2010  DD1   300  110    7930 000         3.526.875,00  H  350   1 7931

-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79304E5 -- 30/11/10 -- 15:41:23 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

Folgende besonderen Feldinhalte werden angezeigt:

	Feldinhalt
TXT	3-stelliger numerischer Buchungstextschlüssel Geld (die komplette Auflistung findet sich in Kapitel 23, Tabellen)
TA	Terminartschlüssel, auf dessen Basis eine Custody Buchung vorgenommen wurde
AG	Ablehnungsgrund, wenn Buchung abgelehnt wurde (Verrechnungsstatus 099): GIF – Gelieferte Instruktion fehlerhaft BST – Abgelehnt wegen Geldbestand INS – Instruktion fehlerhaft von SSP PAK – Paket fehlerhaft

Mit der Eingabe von /vor der entsprechenden Buchung kann in die Detailansicht verzweigt werden:

(A) Detailanzeige – Detailinstruktionen für DD-Verarbeitung/Information

```
TRAN: KNZI FC: ID SB: 7930##01.11.2010#

DETAIL INSTRUKTION FÜR DD-VERARBEITUNG  /  I N F O R M A T I O N      SEITE 1

TAG DER GELDVERRECHNUNG  : 30.11.2010
VERARBEITUNGSLAUF        : DD1            PAKET-NR :  1

RTGS-KONTO (SOLL)        :
RTGS-KONTO (HABEN)       :
KONTO-SOLL               : 7930 000 TESTBANK AG
KONTO-HABEN              : 7750 000 CBF-GEGENKONTO
BETRAG                   :           136.109,40 EUR

BUCHUNGSTEXT     : 051 AUSGL.DD1 1-8
REFERENZ         :
VALUTA           : 30.11.2010             GENETTET KONTOSTAMM :
CUSTODY          : N                      ISIN                :
T2-RELEVANT      : N                      INSTRUKTIONS-ID     : 00000000071946
URSPRUNG         : CL                     INSTR-ID GENETTET   :
STATUS           : 350 VERARBEITET

-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B79304E5 -- 30/11/10 -- 15:42:58 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

```
TRAN: KNZI FC: ID SB: 7930##01.11.2010#

DETAIL INSTRUKTION FÜR DD-VERARBEITUNG  /  I N F O R M A T I O N      SEITE 2

ENDBEGÜNSTIGTER      :

NOMINALE             :               0,000 EUR

LAUF-NR/ORIG-LAUF-NR :     0 / 00000
TERMINART            : 000
HAUPTZAHLSTELLE      :
ISIN                 :
VERARBEITUNGSART     : 000
BID                  : 0000000000000
TAG D.FÄLLIGKEIT     :




-- ID-KZ: 7930000132 -- PW:          ------ B793058S -- 01/11/10 -- 15:42:59 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

6.3 Geldverrechnung für CASCADE-RTS-Geschäfte in Euro (GK)

6.3.1.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Zur Information und Kontrolle der Geldüberweisungsaufträge zu RTS-Geschäften mit Gegenwert EUR steht den Teilnehmern in CASCADE ein Dialog zur Verfügung. Der Einstieg erfolgt über die CASCADE-CBF-Dienste (siehe hierzu Band 1, Abschnitt 0). Von dieser Auswahlmaske ausgehend kann der Geldüberweisungsdienst für RTS-Geschäfte mit Gegenwert EUR durch Eingabe von „GK" angewählt werden. Nach Betätigen der ENTER-Taste erscheint folgendes Auswahlmenü:

6.3.1.1.2 (B) Auswahlmaske Geldüberweisungsdienst

```
TRAN: KVGK FC:    SB: #####09.02.2009

GELDUEBERWEISUNGSDIENST         H A U P T A U S W A H L


          BANK                              CLEARSTREAM BANKING, FRANKFURT

          IK  INFORMATION KAEUFER           IG  INFORMATION GELDUEBERWEISUNG
          IV  INFORMATION VERKAEUFER        BG  BEARBEITEN  GELDUEBERWEISUNG




          ZUSAETZLICHE AUSWAHL     BIC-RTS           : ...........
                                   BANK              : ....
                                   VERARB-STATUS     : ...
                                   VERWENDUNGSZWECK  : .... .........
                                   DATUM             : 09.02.2009



-- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ------ B7930461 -- 09/02/09 -- 10:09:51 --
AE0700F  Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF1:Hilfe  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Mögliche Funktionen:

Funktion	Beschreibung
IK IV	Die Auswahl „Information Käufer“ (IK) bzw. „Information Verkäufer“ (IV) kann aufgerufen werden, um sich über den aktuellen Status der Geldüberweisungsaufträge und der an die Bundesbank übertragenen Widerrufe zu informieren. Hierbei kann weiterhin kontrolliert werden, wann die Überweisung (bzw. der Widerruf) von der CBF versendet wurde bzw. wann eine Rückmeldung hierzu von der Bundesbank eingegangen ist. Beide Teilnehmer (Käufer und Verkäufer) werden gleichermaßen über die Geldüberweisung, die aus ihrem in Auftrag gegebenen RTS-Geschäft erzeugt wurde, informiert. In beiden Funktionen besteht keine Änderungsmöglichkeit.

Zusätzlich zur Eingabe des Funktionscodes kann durch weitere Auswahlkriterien die Selektion der Aufträge eingeschränkt werden:

BIC-RTS	Über das Feld BIC-RTS kann mit Eingabe des 11er BICs eine Einschränkung vorgenommen werden.
BANK	Dieses Feld wird mit der Banknummer des Eingebers gefüllt bzw. vorbelegt. (*Mussfeld*).
VERARBEITUNGSSTATUS	Es kann eine zusätzliche Auswahl über den Verarbeitungsstatus erfolgen. Die einzelnen Ausprägungen des Verarbeitungsstatus können über die PF1-Taste angezeigt werden (*Kannfeld*). (Verarbeitungsstatus siehe Band 2, Abschnitt 7.2)
VERWENDUNGSZWECK	Über den Verwendungszweck kann eine spezielle Geldüberweisung selektiert werden. Aufbau: Eingeber der Match-Instruktion (4-stellig); Auftragsnummer der Match-Instruktion (7-stellig). (*Kannfeld*).
DATUM	Ist in dem Feld das Tagesdatum enthalten, so werden alle aktuellen Geldüberweisungen zu den eingegebenen Auswahlkriterien angezeigt. Wird das Feld mit einem historischen Datum überschrieben, werden alle historischen Geldüberweisungsaufträge (zu den gewünschten Auswahlkriterien) angezeigt. Eine Anzeige ist für maximal zehn Arbeitstage zurück möglich. Dieses Feld wird mit dem Tagesdatum vorbelegt. (*Mussfeld*).

Durch Betätigen der PF1-Taste werden dem Systemnutzer die einzelnen Ausprägungen des Verarbeitungsstatus‘ (VERARB-STATUS) angezeigt:

6.3.1.1.3 (C) Anzeige Verarbeitungs-Status

```
TRAN: KVGK FC:     SB: #####20.03.2009

 PAYMENT ADMINISTRATION            STATUS-CODES

 000 - ENTERED
 050 - VERIFIED
 070 - RELEASED

 100 - SENT TO SSP

 200 - SUCCESSFULLY PROCESSED AT SSP
 250 - PARTIALLY SETTLED AT SSP
 290 - SUCCESSFULLY PROCESSED AT SSP (INPUT BY CBF)

 300 - NOT SETTLED AT SSP
 390 - NOT SETTLED AT SSP (INPUT BY CBF)

 400 - INVALID/RETURNED FROM SSP (GROUP/FILE LEVEL)
 410 - SINGLE INVALID/RETURNED FROM SSP (PAYMENT LEVEL)


-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B79304E4 -- 20/03/09 -- 15:12:10 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

6.3.1.2 Information Käufer (IK)

6.3.1.2.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Wählt der Benutzer die Funktion „IK - Information Käufer" aus, so werden alle Geldüberweisungsaufträge (und Widerrufe) angezeigt, die zu Lasten der vorgegebenen Bank (des Auftraggebers) ausgeführt wurden oder noch ausgeführt werden. Sofern keine weiteren als die Muss-Auswahlkriterien angegeben wurden, werden alle von der CBF erzeugten Geldüberweisungsaufträge und Widerrufe angezeigt. Die Muss-Auswahlkriterien werden vorbelegt. Die Anzeige ist nach dem Verwendungszweck sortiert.

6.3.1.2.2 (B) Tabellarische Anzeige/Information Käufer aktuell

```
TRAN: KVGK FC: IK SB: #7931####10.02.2009

GELDUEBERWEISUNGSDIENST    INFORMATION - KAEUFER                    SEITE   1

UEBERWEISUNGEN ZU LASTEN:   7931  HANDELSBANK AG

KZ   VS  LAST-KTO-RTS  GUT-KTO-RTS          GEGENWERT    VERWENDUNGSZWECK

 _  100  DAKVDEF0259   DAKVDEF0229    6.000.000.000,00  7931  000055002  7930









-- ID-KZ: 7931260002 -- PW:          ------ B7930461 -- 10/02/09 -- 13:18:44 --

PF1:Hilfe  PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Wird auf der Auswahlmaske im Feld „DATUM“ ein historisches Datum eingegeben, so ändert sich die Kopfzeile in „INFORMATION/KAEUFER HISTORISCH".

Das Feld „VS“ enthält den Verarbeitungsstatus. Im Feld „LAST-KONTO-RTS“ wird die Konto-Nummer der Käufer-Bank bei der Bundesbank angezeigt, im Feld „GUT-KONTO-RTS“ wird die Konto-Nummer der Verkäufer-Bank bei der Bundesbank (TARGET2) angezeigt. Im Feld „VERWENDUNGSZWECK“ sind der Eingeber der Match-Instruktion, die Auftrags-Nummer der Match-Instruktion und der Kontrahent (Verkäufer) enthalten. Eine Selektion auf die Kontonummer des Verkäufers ist nicht möglich.

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I" = Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

„D" = Druck aller Daten des selektierten Auftrages (Geldüberweisungsauftrag bzw. Widerruf)

6.3.1.2.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Der Benutzer kann nur einen Auftrag für die Vollanzeige auswählen, d. h. er darf in der Spalte KZ nur ein „I“ eingeben. Außerdem darf „I“ nicht mit der Eingabe eines „D“ kombiniert werden.

Die Markierung mehrerer Aufträge mit dem Kennzeichen „D“ ist dagegen zulässig.

Nach Kennzeichnung eines Auftrages mit „I“ erscheint nachfolgende Anzeige:

6.3.1.2.4 (D) Vollanzeige/Käufer aktuell

```
TRAN: KVGK FC: IK SB: #7931####10.02.2009

GELDUEBERWEISUNGSDIENST       INFORMATION - KAEUFER

                                                                  BIC-RTS
ZU LASTEN :   7931 HANDELSBANK AG                    DAKVDEF0259
ZU GUNSTEN:   7930 TESTBANK AG                     DAKVDEF0229

GEGENWERT:  6.000.000.000,00  EUR                 INSTR-ID: 0123422872581039

VERWENDUNGSZWECK:  7931 /     55002

UEBERWEISUNG ERZEUGT: 13:07:37 UHR
SSP-RUECKMELDUNG:

STATUS       : 100 SENT TO SSP
DISPO-STATUS : 6   RESERVIERT AUF UNTERKONTO, GELD OFFEN




-- ID-KZ: 7931260002 -- PW:          ------ B7931461 -- 10/02/09 -- 13:20:57 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

6.3.1.2.5 (E) Feldbesonderheiten

Im Feld UEBERWEISUNG ERZEUGT wird die Uhrzeit festgehalten, zu der der Geldüberweisungsauftrag maschinell erzeugt wurde. Sie ist gleichzusetzen mit der Uhrzeit der Reservierung der Stücke, weil beide Vorgänge fast zeitgleich durchgeführt werden. Die Versendung des Geldüberweisungsauftrags an die Bundesbank wird im Anschluss daran durchgeführt.

Im Feld Bundesbank-RUECKMELDUNG ist die Uhrzeit enthalten, zu der die jeweilige Quittung (z. B. negative oder positive Quittung) bei der Systems AG eingegangen ist. Bei Empfang einer positiven Quittung ist sie gleichzusetzen mit der Buchung der Stücke an den Käufer, weil diese Verarbeitung sofort nach Erhalt der Quittung angestoßen wird. Bei Empfang einer Widerruf-Quittung, ist sie gleichzusetzen mit der Buchung der Stücke zurück an den Verkäufer.

Im Fall einer Rücknahme der Reservierung durch den Verkäufer werden auch für den Widerruf beide Uhrzeiten festgehalten, und zwar im erzeugten Widerruf. Bei Ansicht des Widerrufs in der Einzelanzeige kann sich der Mitarbeiter hierüber informieren.

6.3.1.3 Information Verkäufer (IV)

6.3.1.3.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Wird in der Auswahlmaske vom Benutzer die Funktion "IV - Information Verkäufer" angewählt, so werden alle Geldüberweisungsaufträge und Widerrufe angezeigt, bei denen der Benutzer als Begünstigter der Geldüberweisung auftritt.

6.3.1.3.2 (B) Tabellarische Anzeige/Information Verkäufer aktuell

```
TRAN: KVGK FC: IV SB: #7930####10.02.2009

GELDUEBERWEISUNGSDIENST    INFORMATION - VERKAEUFER                  SEITE   1

UEBERWEISUNGEN ZU GUNSTEN:  7930  TESTBANK AG

KZ   VS  GUT-KTO-RTS   LAST-KTO-RTS          GEGENWERT    VERWENDUNGSZWECK

 _  100  DAKVDEF0229   DAKVDEF0259    6.000.000.000,00  7931  000055002  7930









-- ID-KZ: 7930260002 -- PW:          ------ B7930461 -- 10/02/09 -- 13:21:50 --
AE0100I  Keine weiteren Daten vorhanden
PF1:Hilfe  PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Wird auf der Auswahlmaske im Feld „DATUM“ ein historisches Datum eingegeben, so ändert sich die Kopfzeile in „INFORMATION/VERKAEUFER HISTORISCH".

Das Feld „VS“ enthält den Verarbeitungsstatus. Im Feld „GUT-KONTO-RTS“ wird der BIC der Verkäufer-Bank bei der Bundesbank angezeigt, im Feld „LAST-KONTO-RTS“ wird der BIC der Käufer-Bank bei der Bundesbank angezeigt. Im Feld „VERWENDUNGSZWECK“ werden der Eingeber und die Auftrags-Nummer der Match-Instruktion angezeigt. Außerdem wird der Kontrahent (Verkäufer) in der rechten Spalte ausgewiesen. Eine Selektion auf die Kontonummer des Verkäufers ist nicht möglich.

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I" = Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

„D" = Druck aller Daten des selektierten Auftrages (Geldüberweisungsauftrag bzw. Widerruf)

6.3.1.3.3 (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Der Benutzer kann nur einen Auftrag für die Vollanzeige auswählen, d. h. er darf in der Spalte KZ nur einen Auftrag mit „I“ kennzeichnen.

Die Markierung mehrerer Aufträge mit dem Kennzeichen „D“ ist dagegen zulässig.

Nach Kennzeichnung eines Auftrages mit „I“ und Datenfreigabe erscheint nachfolgende Anzeige:

6.3.1.3.4 (D) Vollanzeige/Verkäufer aktuell

```
TRAN: KVGK FC: IV SB: #7930####10.02.2009

GELDUEBERWEISUNGSDIENST       INFORMATION - VERKAEUFER

                                                                BIC-RTS
ZU GUNSTEN:   7930 TESTBANK AG                    DAKVDEF0229
ZU LASTEN :   7931 HANDELSBANK AG                    DAKVDEF0259

GEGENWERT:  6.000.000.000,00  EUR                 INSTR-ID: 0123422872581039

VERWENDUNGSZWECK:  7931 /     55002

UEBERWEISUNG ERZEUGT: 13:07:37 UHR
SSP-RUECKMELDUNG:

STATUS       : 100 SENT TO SSP
DISPO-STATUS : 6   RESERVIERT AUF UNTERKONTO, GELD OFFEN




-- ID-KZ: 7931260002 -- PW:          ------ B7931461 -- 10/02/09 -- 13:22:01 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

6.3.1.3.5 (E) Feldbesonderheiten

Im Feld UEBERWEISUNG ERZEUGT wird die Uhrzeit festgehalten, zu der der Geldüberweisungsauftrag maschinell erzeugt wurde. Sie ist gleichzusetzen mit der Uhrzeit der Reservierung der Stücke, weil beide Vorgänge nahezu zeitgleich durchgeführt werden. Die Versendung des Geldüberweisungsauftrags an die Bundesbank wird im Anschluss daran durchgeführt.

Im Feld LZB-RUECKMELDUNG ist die Uhrzeit enthalten, zu der die jeweilige Quittung (z. B. negative oder positive Quittung) bei der Systems AG eingegangen ist. Bei Empfang einer positiven Quittung ist sie gleichzusetzen mit der Buchung der Stücke an den Käufer, weil diese Verarbeitung sofort nach Erhalt angestoßen wird. Bei Empfang einer Widerruf-Quittung, ist sie gleichzusetzen mit der Buchung der Stücke zurück an den Verkäufer.

Im Fall einer Rücknahme der Reservierung durch den Verkäufer werden auch für den Widerruf beide Uhrzeiten festgehalten, und zwar im erzeugten Widerruf. Bei Ansicht des Widerrufs in der Einzelanzeige kann sich der Mitarbeiter hierüber informieren.

7 Geldregulierung in Fremdwährung (GC)

Geldverrechnung in Fremdwährung wird nur auf Basis von Commercial Bank Money Guthaben vorgenommen nach erfolgter Stückereservierung. Die Settlementart kann nur RTS sein. Abweichende Eingaben werden nicht zugelassen. Die Match-Toleranzwerte für Fremdwährungen sind dem Kapitel bezüglich Matching zu entnehmen.

7.1 Information von CASCADE-FWG-Geschäften

7.1.1.1.1 (A) Allgemeine Beschreibung

Der Benutzer kann die Auswahl der angezeigten CASCADE-Fremdwährungs-Aufträge und/oder LION-Fremdwährungsgeschäfte in der Auswahlmaske einschränken nach

- Käufe
- Verkäufe oder
- Gesamt d. h. alle Fremdwährungs-Aufträge.

Eine Bearbeitung ist durch den Kunden nicht möglich.

Mit der Auswahl „GC“ wird folgende Auswahlmaske angezeigt:

7.1.1.1.2 (B) Auswahlmaske Geldkontrolle Commercial Bank Money

```
TRAN: KVGC FC:    SB:

GELDKONTROLLE CBM               H A U P T A U S W A H L


          BANK                              CLEARSTREAM BANKING, FRANKFURT

          IK  INFORMATION KAEUFER           BG  BEARBEITEN  GELDBUCHUNG
          IV  INFORMATION VERKAEUFER
          IG  INFORMATION GESAMT

          AUSWAHL
          BANK              : 7930

          VALUTA            : ..........
          WRG               : ...
          VERARB-STATUS     : ...
          HERKUNFT (ART)    : ... (CAS: CASCADE  LIO: LION)
          AUFTNR/GSNR       : .........


-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B793043W -- 02/06/09 -- 11:35:10 --

PF1:Hilfe  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Mögliche Funktionen (FC):

„IK" = Wählt der Benutzer die Funktion „IK - Information Käufer" aus, so werden alle CBM-Geldaufträge (und Widerrufe) angezeigt, die zu Lasten der vorgegebenen Bank (des Auftraggebers) ausgeführt wurden oder noch ausgeführt werden.

„IV" = Wählt der Benutzer die Funktion „IV - Information Verkäufer" aus, so werden alle CBM-Geldaufträge (und Widerrufe) angezeigt, die zu Gunsten der vorgegebenen Bank (des Auftraggebers) ausgeführt wurden oder noch ausgeführt werden.

„IG" = Wählt der Benutzer die Funktion „IG - Information Gesamt" aus, so werden alle CBM-Geldaufträge (und Widerrufe) angezeigt, die zu Lasten oder zu Gunsten der vorgegebenen Bank (des Auftraggebers) ausgeführt wurden oder noch ausgeführt werden.

Funktion Code	Beschreibung
IK IV IG	Die Auswahl IK, IV oder IG kann aufgerufen werden, um sich über den aktuellen Status der Fremdwährungszahlungen und der an Creation übertragenen Widerrufe zu informieren. Hierbei kann weiterhin kontrolliert werden, wann die Zahlungsinstruktion (bzw. der Widerruf) von CBF versendet wurde bzw. wann eine Rückmeldung hierzu eingegangen ist. Beide Teilnehmer (Käufer und Verkäufer) werden gleichermaßen über die Geldüberweisung, die aus ihrem in Auftrag gegebenen erzeugt wurde, informiert. In allen Funktionen besteht keine Änderungsmöglichkeit für CBF Kunden.

Zusätzlich zur Eingabe des Funktionscodes kann durch weitere Auswahlkriterien die Selektion der Aufträge eingeschränkt werden:

BANK	Dieses Feld wird mit der Banknummer des jeweiligen Benutzers vorbelegt.
VALUTA	Ist in dem Feld das Tagesdatum enthalten, so werden alle aktuellen Fremdwährungs-Geldaufträge zu den eingegebenen Auswahlkriterien angezeigt. Wird das Feld mit einem historischen Datum überschrieben, werden alle historischen Geldaufträge (zu den gewünschten Auswahlkriterien) angezeigt. Eine Anzeige ist für maximal zehn Arbeitstage zurück möglich. Dieses Feld wird mit dem Tagesdatum vorbelegt. (Mussfeld außer, die AUFTNR/GSNR wird angegeben)
WRG	Der ISO-Code der Fremdwährung führt zu einer begrenzten Anzeige von nur in dieser Währung gültigen Instruktionen. (Kannfeld)
VERARBEITUNGSSTATUS	Es kann eine zusätzliche Auswahl über den Verarbeitungsstatus erfolgen. Die einzelnen Ausprägungen des Verarbeitungsstatus können über die PF1-Taste angezeigt werden (Kannfeld). (Verarbeitungsstatus siehe Anhang)
HERKUNFT	Durch Eingabe kann zwischen CASCADE OTC- und LION-Börsengeschäften unterschieden werden. (Kannfeld)
AUFTNR/GSNR	Soll der Geldauftrag eines bestimmten Auftrags angezeigt werden, so kann durch Eintrag der entsprechenden Auftragsnummer (CASCADE; sowohl Match-Auftrag wie Match-Instruktion ist eingebbar) direkt dieser Geldauftrag eingesehen werden. Existieren zu einer AUFTNR/GSNR mehr als eine Transaktion (Eingabe derselben Nummer erfolgte durch verschiedene Eingeber), werden diese alle angezeigt.

Durch Betätigen der PF1-Taste werden dem Systemnutzer die einzelnen Ausprägungen des „Verarbeitungsstatus" (VERARB-STATUS) angezeigt.

7.1.2 Anzeige Verarbeitungs-Status

Durch Drücken der PF-1-Taste wird ein Hilfeschirm aktiviert, der die Status-Ausprägungen erläutert (CBM steht dabei für Commercial Bank Money, CBL steht für Commercial Bank Money Geldabwicklungssystem)

7.1.2.1 Hilfebildschirm (PF-1-Taste)

```
TRAN: KVGC FC:    SB: #12.06.2009#####

------------ ANZEIGE DER VERARBEITUNGS-STATUS UND IHRER BEDEUTUNG -----------

100 - CBM Instruktion erstellt und an CBL übertragen
150 - CBM gebucht (Stücke weiterhin nur reserviert)

200 - Stücke und CBM erfolgreich gebucht (automatisch)
290 - Stücke und CBM erfolgreich gebucht (manuell)

500 - CBM gebucht, Rückn. Reservierung Stücke durch CSD (oder EoD-Processsing)
501 - Rücknahme Reservierung Stücke durch CSD (oder EoD-Processing)
590 - CBM Instruktion manuell abgelehnt durch CBF

600 - Widerruf der CBM Instruktion an CBL übertragen

800 - Widerruf der CBM Instruktion erfolgt (automatisch)
890 - Widerruf der CBM Instruktion erfolgt (manuell)

900 - Widerruf bei CBL nicht erfolgreich, da Stücke und CBM gebucht (autom.)
990 - Widerruf bei CBL nicht erfolgreich, da Stücke und CBM gebucht (manuell)
-- ID-KZ: 7930264002 -- PW:          ------ B793043G -- 29/06/09 -- 09:17:15 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Zusätzlicher Hinweis: Eine finale Ablehnung mangels FWG-Bestand ist nicht vorgesehen. Alle Geldinstruktionen werden innerhalb der Tagesverarbeitung vorgetragen.

7.1.3 Tabellarische Kurzanzeige der FWG-Aufträge

Nach Setzen der Selektionskriterien und Datenfreigabe (Eingabe- oder PF-3-Taste) erhält der Benutzer die Informationen der entsprechenden Fremdwährungs-Buchungen tabellarisch angezeigt.

```
TRAN: KVGC FC: IG SB: #######02.06.2009

GELDKONTROLLE CBM          INFORMATION GELDBUCHUNGEN                SEITE   1

VALUTA: 02.06.2009

            WP-KONTEN                          AUFTNR MI AUFTNR MA   CBM-KONTEN
KZ  VS ART  GUT  LAST        GEGENWERT WRG        GSNR                SOLL HABEN

 - 100 CAS 7930  8501             0,99 USD  123456789 123456788  67930 68501
 - 100 CAS 7930  8501             0,01 USD  123456787 123456786  67930 68501
 - 590 CAS 7930  6789         5.000,00 USD          99         9  67930 66789
 - 290 LIO 7930  6789           200,00 USD           2            67930 66789
 - 200 LIO 7930  6789            10,00 USD           1            67930 66789




GESAMTSUMME :                 5.211,00 USD        AUS       5 POSTEN

-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B793043W -- 02/06/09 -- 13:32:32 --
PF1:Hilfe  PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I" = Wird eine Transaktion unter der Spalte KZ gekennzeichnet, so gelangt der Benutzer in die Vollanzeige

„D" = Mit D wird der Ausdruck der Geldbuchung eingeleitet

Details zur Anzeige

- Die Bezeichnung GESAMTSUMME/AUS wird am Bildschirm ausgewiesen, wenn eine WRG gewählt wurde
- Die Anzahl Posten wird immer ausgewiesen
- PF7,PF8-Tasten für Vor/Zurückblättern
- Sortierreihenfolge der angezeigten FWG-Buchungen, sofern nicht durch Auswahl eingeschränkt:

1) Verarbeitungsstatus analog Aufstellung:

   100 - CBM Instruktion erstellt und an CBL übertragen

   150 - CBM gebucht (Stücke weiterhin nur reserviert)

   200 - Stücke und CBM erfolgreich gebucht (automatisch)

   290 - Stücke und CBM erfolgreich gebucht (manuell)

   500 - CBM gebucht, Rückn. Reservierung Stücke durch CSD (oder EoD-Processing)

   501 - Rücknahme Reservierung Stücke durch CSD (oder EoD-Processing)

   590 - CBM Instruktion manuell abgelehnt durch CBF

   600 - Widerruf der CBM Instruktion an CBL übertragen

   800 - Widerruf der CBM Instruktion erfolgt (automatisch)

   890 - Widerruf der CBM Instruktion erfolgt (manuell)

   900 - Widerruf bei CBL nicht erfolgreich, da Stücke und CBM gebucht (autom.)

   990 - Widerruf bei CBL nicht erfolgreich, da Stücke und CBM gebucht (manuell)

2) Gegenwert: absteigend („hoch oben“)

3) WRG absteigend (Währung „ZAR oben“)

4) GUT – aufsteigend

5) LAST – aufsteigend

6) ART (Herkunft) - aufsteigend

7.1.4 Vollanzeige

Durch Markierung einer bestimmten FWG-Buchung (mit „I") in der tabellarischen Auswahl oder durch Angabe der AUFTNR/GSNR in der Auswahlmaske werden die Details zu der selektierten Buchung angezeigt.

```
TRAN: KVGC FC: IG SB:

GELDKONTROLLE CBM            INFORMATION GELDBUCHUNG

                                                                CBM-KONTO
GUT :   7930 TESTBANK AG                                    SOLL : 67930
LAST:   8501 EUREX CLEARING AG EQUITY CCP                   HABEN: 68501

GEGENWERT:999.999.999.999,99  USD                    AUFTNR MI:    1234567
NOMINALE :            500,00  ST                     AUFTNR MA:    9876543
WKN/ISIN :    I DE0009998887  TEST-ISIN AG           HERKUNFT :    CASCADE
                                                     SET-DAY  : 02.06.2009
VALUTA   : 02.06.2009

STATUS   ZEIT       DATUM  USER-ID          REFERENZ-NR MI: 0811-7399860-001
   290  10.35  30.05.2009  7907000100       REFERENZ-NR MA: 0811-7399860-001
   100  22.20  02.06.2009




-- ID-KZ: 7930000001 -- PW:          ------ B793043W -- 02/06/09 -- 11:26:58 --
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Details zur Anzeige

Der Spaltenkopf USER-ID wird nur angezeigt, wenn mindestens eine User-ID angezeigt werden kann.

Sortier-Reihenfolge der Status-Anzeige: Datum/Zeit absteigend (aktuell = oben)

Kontakt
www.clearstream.com

Veröffentlicht von

Clearstream Banking Frankfurt
Eingetragene Adresse
Clearstream Banking AG, Frankfurt
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn
Deutschland

Postanschrift
Clearstream Banking AG
60485 Frankfurt /Main
Deutschland

April 2015